

# GBMfondos

## GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	KUO	B	BAJA	3,627,649	145,650,107.35	21.21
1	CULTIBA	B	BAJA	10,136,115	126,600,076.35	18.43
1	CYDSASA	A	BAJA	6,379,508	122,677,938.84	17.86
1	FRAGUA	B	MEDIA	184,560	91,449,480.00	13.32
1	GISSA	A	MEDIA	1,920,000	59,289,600.00	8.63
1	GMD	*	BAJA	3,623,451	47,104,863.00	6.86
1	PASA	B	MINIMA	2,190,591	31,544,510.40	4.59
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,465,000	15,587,600.00	2.27
1				1,788,115	45,879,496.40	6.68
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>685,783,672.34</b>	<b>99.85</b>
<b>OTROS VALORES</b>				9,871	<b>1,026,364.46</b>	<b>0.15</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>686,810,036.80</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b>	
	RVDIS	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Límite de VaR</b>
	0.817%	2.740%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de Inversión administrados por Operadora GBM, se acordó con la empresa Valor de Mercado (Valmer) que sea ella quien lo realice, siguiendo los criterios metodológicos aprobados por la Unidad de Administración Integral de riesgos de la Operadora.

El método utilizado para la estimación del VaR es el conocido como simulación histórica, con los parámetros que se presentan a continuación:

- Un periodo de muestra de un año
- El nivel de confianza para el VaR fijado al 95%
- El horizonte temporal para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día

Lic. Julio Andres Maza Casas