

gbmfondos

GBM106 GBM 106, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DIRECTO					
ACCIONES DE FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	GBMDOL	BFF	NA	1,088,574,324.60	3.17
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ASP	CNK	*	ALTA	3,867,101,933.76	11.27
1ASP	AAPL	*	ALTA	2,913,527,838.75	8.49
1ASP	AMZN	*	ALTA	2,159,855,814.00	6.30
1ASP	CGX	N	ALTA	890,526,954.00	2.60
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					
1	ALSEA	*	ALTA	2,367,000,000.00	6.90
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA					
CF	FUNO	11	ALTA	3,363,000,000.00	9.80
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ISP	IB01	N	ALTA	16,995,415,785.52	49.54
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					
				33,645,002,650.63	98.07
OTROS VALORES				660,697,998.08	1.93
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				34,305,700,648.71	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.853%

Límite de VaR
3.960%

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

Composición de las Carteras de los Fondos Origen

