

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ASP	NVDA	*	ALTA	84,558	253,482,428.44	10.31
1ASP	META	*	ALTA	13,550	159,742,682.72	6.49
1ASP	AMZN	*	ALTA	33,573	145,025,678.49	5.90
1ASP	GOOG	*	ALTA	34,886	126,376,936.38	5.14
1ASP	V	*	ALTA	18,019	113,453,846.41	4.61
1ASP	MSFT	*	ALTA	10,421	90,867,971.08	3.69
1ASP	NFLX	*	ALTA	5,279	90,281,228.29	3.67
1ASP	COST	*	ALTA	3,969	74,900,862.56	3.05
1ASP	HD	*	ALTA	7,911	65,560,650.66	2.67
1ASP	LLY	*	ALTA	3,925	63,033,979.47	2.56
1ASP	MNST	*	ALTA	46,350	52,980,115.17	2.15
1ASP	TXN	*	ALTA	12,396	52,159,598.73	2.12
1ASP	AVGO	*	ALTA	14,662	51,026,676.54	2.07
1ASP	VRTX	*	ALTA	5,136	50,771,493.27	2.06
1ASP	CPRT	*	ALTA	43,223	50,624,185.55	2.06
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				188,545	789,418,208.50	32.09
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,229,706,542.26	90.65
PRESTAMO DE VALORES						
1ASP	MSFT	*	ALTA	13,000	113,356,071.78	4.61
1ASP	AMZN	*	ALTA	15,000	64,795,674.42	2.63
OTROS VALORES				4,579,616	51,855,711.95	2.11
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,459,714,000.41	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					178,151,746.20	7.24

	CATEGORÍA	
	RVESACCINT	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.707%	2.980%

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