

GBMfondos

GBM110 GBM 110, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 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	UMG	N	ALTA	32,000	16,062,828.45	5.29
1ASP	PDD	N	ALTA	6,550	15,805,899.52	5.21
1ASP	LULU	*	ALTA	2,500	14,903,117.78	4.91
1ASP	YUMC	*	ALTA	16,600	14,652,501.26	4.83
1ASP	NKE	*	ALTA	7,000	10,804,085.02	3.56
1ASP	CPR	N	ALTA	72,000	9,674,235.14	3.19
1ASP	AMZN	*	ALTA	2,500	9,325,079.40	3.07
1ASP	DEO	N	ALTA	3,400	8,447,481.37	2.78
1ASP	GOLD	N	ALTA	20,000	7,732,211.76	2.55
1ASP	SLB	N	ALTA	8,000	6,414,694.10	2.11
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	300,000	16,506,000.00	5.44
1	CUERVO	*	ALTA	445,637	11,720,253.10	3.86
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IB01	N	ALTA	46,521	105,231,997.00	34.66
1ISP	PSQ	*	ALTA	30,000	23,995,070.19	7.90
1ISP	SHV	*	ALTA	3,297	7,294,629.51	2.40
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					278,570,083.60	91.75
REPORTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	1,703,805	15,167,844.60	5.00
TOTAL REPORTO					15,167,844.60	5.00
OTROS VALORES				20,300	9,874,542.74	3.25
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					303,612,470.94	100.00

CATEGORÍA ESRV

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.960%

Limite de VaR
3.250%

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