

GBMfondos

GBM112 GBM 112, 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 | BRKB | * | ALTA | 12,467 | 112,493,668.45 | 20.32 |
| 1ASP | GOOGL | * | ALTA | 5,000 | 17,120,325.50 | 3.09 |
| ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS | | | | | | |
| 1 | GFINBUR | O | ALTA | 1,169,526 | 52,546,803.18 | 9.49 |
| 1 | Q | * | ALTA | 364,779 | 51,065,412.21 | 9.22 |
| 1 | FEMSA | UBD | ALTA | 200,000 | 38,846,000.00 | 7.02 |
| 1 | GRUMA | B | ALTA | 47,570 | 16,442,094.80 | 2.97 |
| 1 | GMEXICO | B | ALTA | 110,000 | 11,515,900.00 | 2.08 |
| OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS | | | | 3,069,477 | 37,013,851.47 | 6.68 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 337,044,055.61 | 60.87 |
| REPORTO | | | | | | |
| BI | CETES | 251224 | mxAAA | 5,397,172 | 48,047,438.62 | 8.68 |
| TOTAL REPORTO | | | | | 48,047,438.62 | 8.68 |
| PRESTAMO DE VALORES | | | | | | |
| 1 | FEMSA | UBD | ALTA | 300,000 | 58,269,000.00 | 10.52 |
| 1 | GMEXICO | B | ALTA | 500,000 | 52,345,000.00 | 9.45 |
| 1ISP | SHV | * | ALTA | 12,067 | 26,698,299.75 | 4.82 |
| OTROS VALORES | | | | 267,581 | 31,298,375.97 | 5.65 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 553,702,169.95 | 100.00 |
| TOTAL PRESTAMO DE VALORES | | | | | 137,312,299.75 | 24.80 |

CATEGORÍA RVESACCLAT

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.013%

Límite de VaR
2.600%

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