

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
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	NVDA	*	ALTA	84,073	223,352,290.29	9.86
1ASP	META	*	ALTA	13,403	152,228,414.09	6.72
1ASP	AMZN	*	ALTA	38,369	143,117,588.60	6.32
1ASP	GOOG	*	ALTA	34,486	119,172,660.52	5.26
1ASP	MSFT	*	ALTA	13,320	108,310,637.14	4.78
1ASP	V	*	ALTA	17,813	103,318,238.77	4.56
1ASP	NFLX	*	ALTA	5,257	79,532,315.70	3.51
1ASP	COST	*	ALTA	3,923	68,625,543.35	3.03
1ASP	LLY	*	ALTA	3,880	64,422,915.36	2.84
1ASP	HD	*	ALTA	7,820	61,616,062.46	2.72
1ASP	MNST	*	ALTA	50,460	53,193,630.74	2.35
1ASP	VRTX	*	ALTA	5,528	52,653,029.07	2.32
1ASP	TXN	*	ALTA	12,344	50,183,475.90	2.22
1ASP	AVGO	*	ALTA	14,555	49,446,980.93	2.18
1ASP	ANET	*	ALTA	6,367	49,236,088.65	2.17
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				218,126	718,083,394.04	31.70
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,096,493,265.61	92.54
PRESTAMO DE VALORES						
1ASP	MSFT	*	ALTA	10,000	81,314,292.15	3.59
OTROS VALORES				4,404,626	87,752,871.74	3.87
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,265,560,429.50	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					81,314,292.15	3.59

CATEGORÍA
RVESACCINT

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.686%

Límite de VaR
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