

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 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	MSFT	*	ALTA	29,137	238,137,198.95	9.83
1ASP	NVDA	*	ALTA	97,073	219,295,395.99	9.05
1ASP	AMZN	*	ALTA	38,246	135,154,026.50	5.58
1ASP	GOOG	*	ALTA	38,791	130,107,139.90	5.37
1ASP	META	*	ALTA	12,249	112,939,059.84	4.66
1ASP	V	*	ALTA	21,209	101,794,269.19	4.20
1ASP	ISRG	*	ALTA	9,558	77,750,660.40	3.21
1ASP	COST	*	ALTA	4,810	74,762,249.13	3.09
1ASP	VRTX	*	ALTA	8,589	73,617,243.73	3.04
1ASP	QCOM	*	ALTA	17,728	64,569,724.96	2.66
1ASP	ANET	*	ALTA	10,038	64,333,013.76	2.66
1ASP	NFLX	*	ALTA	5,188	64,025,059.52	2.64
1ASP	LLY	*	ALTA	3,732	61,786,841.81	2.55
1ASP	MNST	*	ALTA	65,159	59,515,949.76	2.46
1ASP	UNH	*	ALTA	6,207	57,802,254.33	2.39
1ASP	CPRT	*	ALTA	50,829	50,340,055.11	2.08
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				186,966	692,098,111.22	28.56
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BIL	*	ALTA	63,675	106,866,225.99	4.41
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,384,894,480.09	98.43
OTROS VALORES				204,197	38,078,173.10	1.57
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,422,972,653.19	100.00

CATEGORÍA RVESACCINT

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.321%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas