

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 16 MAYO, 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	30,511	214,274,816.53	9.89
1ASP	NVDA	*	ALTA	10,148	159,737,432.01	7.37
1ASP	GOOG	*	ALTA	39,698	116,175,727.53	5.36
1ASP	AMZN	*	ALTA	36,274	111,117,380.05	5.13
1ASP	V	*	ALTA	21,610	100,880,556.45	4.66
1ASP	META	*	ALTA	11,339	89,513,787.62	4.13
1ASP	COST	*	ALTA	4,989	66,003,647.44	3.05
1ASP	ISRG	*	ALTA	9,915	65,569,540.63	3.03
1ASP	VRTX	*	ALTA	8,863	65,148,973.60	3.01
1ASP	QCOM	*	ALTA	18,451	59,487,712.01	2.75
1ASP	MNST	*	ALTA	65,159	58,794,175.18	2.71
1ASP	ANET	*	ALTA	10,448	55,788,949.08	2.57
1ASP	LLY	*	ALTA	3,860	49,653,764.72	2.29
1ASP	CPRT	*	ALTA	52,952	48,212,406.49	2.22
1ASP	NFLX	*	ALTA	4,452	45,341,716.93	2.09
1ASP	IDXX	*	ALTA	4,856	43,819,829.64	2.02
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				190,714	642,585,571.95	29.65
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BIL	*	ALTA	63,675	97,341,255.68	4.49
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,089,447,243.54	96.42
PRESTAMO DE VALORES						
1ASP	UNH	*	ALTA	5,000	43,478,609.43	2.01
OTROS VALORES				373,661	34,150,417.25	1.58
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,167,076,270.22	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					43,478,609.43	2.01

CATEGORÍA
RVESACCINT

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.343%

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 período 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