

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 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	NVDA	*	ALTA	97,073	221,569,812.88	9.02
1ASP	AMZN	*	ALTA	38,246	139,298,857.59	5.67
1ASP	MSFT	*	ALTA	16,137	134,524,891.52	5.48
1ASP	GOOG	*	ALTA	38,791	133,435,933.86	5.43
1ASP	META	*	ALTA	12,249	117,155,268.09	4.77
1ASP	V	*	ALTA	21,209	104,085,330.65	4.24
1ASP	ISRG	*	ALTA	9,558	78,317,687.77	3.19
1ASP	COST	*	ALTA	4,810	75,319,277.52	3.07
1ASP	VRTX	*	ALTA	8,589	74,710,060.19	3.04
1ASP	NFLX	*	ALTA	5,188	65,357,792.06	2.66
1ASP	ANET	*	ALTA	10,038	64,293,126.84	2.62
1ASP	QCOM	*	ALTA	17,728	63,687,437.93	2.59
1ASP	LLY	*	ALTA	3,732	62,452,540.28	2.54
1ASP	MNST	*	ALTA	65,159	60,658,664.39	2.47
1ASP	UNH	*	ALTA	6,207	55,582,298.80	2.26
1ASP	CPRT	*	ALTA	50,829	51,238,981.02	2.09
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				186,966	700,616,212.33	28.53
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BIL	*	ALTA	63,675	107,547,546.20	4.38
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,309,851,719.92	94.08
PRESTAMO DE VALORES						
1ASP	MSFT	*	ALTA	13,000	108,373,526.04	4.41
OTROS VALORES					186,223	1.51
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,455,295,261.94	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					108,373,526.04	4.41

	CATEGORÍA RVESACCINT	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 1.320%	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