

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 25 JULIO, 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	17,183	132,661,079.32	6.32
1ASP	NVDA	*	ALTA	58,719	121,656,107.08	5.79
1ASP	AMZN	*	ALTA	35,665	118,360,156.55	5.64
1ASP	GOOG	*	ALTA	34,709	108,340,949.72	5.16
1ASP	META	*	ALTA	11,810	98,808,396.70	4.71
1ASP	V	*	ALTA	19,041	89,152,094.14	4.25
1ASP	VRTX	*	ALTA	7,685	69,805,763.19	3.33
1ASP	COST	*	ALTA	4,302	64,771,926.33	3.09
1ASP	ISRG	*	ALTA	7,381	59,482,749.58	2.83
1ASP	LLY	*	ALTA	3,622	54,883,899.26	2.61
1ASP	NFLX	*	ALTA	4,630	54,173,233.12	2.58
1ASP	MNST	*	ALTA	58,263	53,862,118.28	2.57
1ASP	ANET	*	ALTA	9,012	52,235,966.21	2.49
1ASP	QCOM	*	ALTA	15,916	51,510,008.20	2.45
1ASP	UNH	*	ALTA	4,638	47,898,663.16	2.28
1ASP	HD	*	ALTA	6,608	43,077,871.80	2.05
1ASP	CPRT	*	ALTA	45,677	42,504,939.36	2.02
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				172,707	557,532,900.56	26.56
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BIL	*	ALTA	52,675	89,150,021.19	4.25
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,909,868,843.75	90.97
PRESTAMO DE VALORES						
1ASP	MSFT	*	ALTA	9,000	69,484,357.44	3.31
1ASP	NVDA	*	ALTA	30,812	63,837,394.56	3.04
OTROS VALORES					191,878	2.68
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,099,356,959.06	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					133,321,752.00	6.35

	CATEGORÍA RVESACCINT	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 1.418%	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