

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 05 SEPTIEMBRE, 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	AMZN	*	ALTA	47,801	169,486,471.38	7.03	
1ASP	MSFT	*	ALTA	18,227	148,366,828.59	6.15	
1ASP	META	*	ALTA	13,988	144,103,678.67	5.98	
1ASP	NVDA	*	ALTA	65,509	139,985,414.20	5.81	
1ASP	GOOG	*	ALTA	39,329	124,326,185.08	5.16	
1ASP	V	*	ALTA	20,314	112,811,729.33	4.68	
1ASP	COST	*	ALTA	4,591	81,073,277.77	3.36	
1ASP	VRTX	*	ALTA	8,198	76,564,758.03	3.18	
1ASP	NFLX	*	ALTA	5,609	76,426,983.84	3.17	
1ASP	LLY	*	ALTA	3,862	70,260,402.24	2.91	
1ASP	MNST	*	ALTA	62,154	59,736,917.71	2.48	
1ASP	HD	*	ALTA	8,026	57,886,095.01	2.40	
1ASP	ANET	*	ALTA	8,816	57,713,065.86	2.39	
1ASP	QCOM	*	ALTA	16,979	55,399,686.67	2.30	
1ASP	ISRG	*	ALTA	5,459	51,867,540.70	2.15	
1ASP	TXN	*	ALTA	12,823	51,513,251.76	2.14	
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAM)				237,930	730,845,278.16	30.31	
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,208,367,565.00	91.59	
PRESTAMO DE VALORES							
1ASP	MSFT	*	ALTA	8,000	65,119,582.42	2.70	
OTROS VALORES					145,769	137,617,885.34	5.71
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,411,105,032.76	100.00	
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					65,119,582.42	2.70	

	CATEGORÍA RVESACCINT	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 1.635%	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