

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 05 DICIEMBRE, 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	90,769	266,029,030.92	9.99
1ASP	META	*	ALTA	14,551	179,021,017.01	6.73
1ASP	MSFT	*	ALTA	19,806	177,121,636.83	6.65
1ASP	AMZN	*	ALTA	37,162	165,596,040.96	6.22
1ASP	GOOG	*	ALTA	37,464	131,941,147.27	4.96
1ASP	V	*	ALTA	19,351	120,842,061.35	4.54
1ASP	NFLX	*	ALTA	5,886	109,155,404.07	4.10
1ASP	COST	*	ALTA	4,262	84,583,122.31	3.18
1ASP	HD	*	ALTA	8,834	76,130,900.71	2.86
1ASP	LLY	*	ALTA	4,215	70,310,727.61	2.64
1ASP	CPRT	*	ALTA	45,029	56,324,444.18	2.12
1ASP	ANET	*	ALTA	25,919	55,944,227.14	2.10
1ASP	AVGO	*	ALTA	15,745	54,229,354.45	2.04
1ASP	MNST	*	ALTA	49,743	53,366,694.48	2.00
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				221,474	923,513,529.34	34.69
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,524,109,338.63	94.82
PRESTAMO DE VALORES						
1ASP	AMZN	*	ALTA	15,000	66,840,875.48	2.51
OTROS VALORES				955,051	71,060,599.59	2.67
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,662,010,813.70	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					66,840,875.48	2.51

CATEGORÍA
RVESACCINT

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.725%

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