

GBMfondos

GBMINIT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2023

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	31,736	193,418,282.88	10.52
1ASP	UNH	*	ALTA	11,043	106,606,215.26	5.80
1ASP	GOOG	*	ALTA	44,028	99,441,427.26	5.41
1ASP	V	*	ALTA	22,075	93,549,325.73	5.09
1ASP	NVDA	*	ALTA	10,092	74,184,262.50	4.03
1ASP	VRTX	*	ALTA	8,908	58,144,420.57	3.16
1ASP	MNST	*	ALTA	62,576	57,638,944.46	3.13
1ASP	AMZN	*	ALTA	23,641	56,715,085.13	3.08
1ASP	ADBE	*	ALTA	5,358	51,386,689.47	2.79
1ASP	COST	*	ALTA	4,989	49,680,498.02	2.70
1ASP	ISRG	*	ALTA	9,847	46,543,289.17	2.53
1ASP	FTNT	*	ALTA	42,279	43,569,263.55	2.37
1ASP	ZTS	*	ALTA	14,964	42,348,172.37	2.30
1ASP	CPRT	*	ALTA	52,706	41,346,263.17	2.25
1ASP	LLY	*	ALTA	3,912	39,060,792.72	2.12
1ASP	ANET	*	ALTA	10,528	38,024,708.61	2.07
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				189,527	616,067,698.52	33.50
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1SP	BIL	*	ALTA	57,000	94,340,780.37	5.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,802,066,119.76	97.98
OTROS VALORES				259,098	37,203,297.80	2.02
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,839,269,417.56	100.00

CATEGORÍA
RVESACCINT

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.655%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas