

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 23 NOVIEMBRE, 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	31,344	203,583,296.58	10.75
1ASP	GOOG	*	ALTA	43,002	103,501,590.95	5.47
1ASP	UNH	*	ALTA	10,904	101,920,465.15	5.38
1ASP	V	*	ALTA	21,796	95,060,435.43	5.02
1ASP	MNST	*	ALTA	62,576	59,398,092.48	3.14
1ASP	ADBE	*	ALTA	5,343	56,917,915.12	3.01
1ASP	AMZN	*	ALTA	21,607	54,490,712.47	2.88
1ASP	VRTX	*	ALTA	8,899	54,033,995.89	2.85
1ASP	ISRG	*	ALTA	9,790	53,145,086.08	2.81
1ASP	COST	*	ALTA	4,935	49,972,345.33	2.64
1ASP	NVDA	*	ALTA	5,907	49,466,011.03	2.61
1ASP	ZTS	*	ALTA	14,964	46,133,603.41	2.44
1ASP	CPRT	*	ALTA	52,706	46,106,356.70	2.44
1ASP	QCOM	*	ALTA	18,373	40,267,860.66	2.13
1ASP	IDXX	*	ALTA	4,887	40,182,620.55	2.12
1ASP	ANET	*	ALTA	10,528	39,396,047.55	2.08
1ASP	LLY	*	ALTA	3,812	38,994,543.60	2.06
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				200,395	584,644,780.15	30.88
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BIL	*	ALTA	54,000	85,166,368.65	4.50
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,802,382,127.78	95.21
OTROS VALORES				275,041	90,666,106.72	4.79
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,893,048,234.50	100.00

	CATEGORÍA	
	RVESACCINT	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.638%	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