

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 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	9,640	144,095,406.25	7.00
1ASP	AMZN	*	ALTA	35,868	106,830,484.16	5.19
1ASP	V	*	ALTA	21,076	97,397,860.18	4.73
1ASP	GOOG	*	ALTA	37,416	94,157,597.85	4.57
1ASP	UNH	*	ALTA	11,434	93,381,120.69	4.54
1ASP	MNST	*	ALTA	64,486	63,228,523.00	3.07
1ASP	ISRG	*	ALTA	9,466	62,727,928.06	3.05
1ASP	VRTX	*	ALTA	8,506	58,792,302.43	2.86
1ASP	COST	*	ALTA	4,763	57,751,732.23	2.81
1ASP	QCOM	*	ALTA	17,233	48,273,348.87	2.34
1ASP	CPRT	*	ALTA	49,456	46,886,142.60	2.28
1ASP	LLY	*	ALTA	3,628	46,759,863.48	2.27
1ASP	ANET	*	ALTA	9,758	46,611,922.92	2.26
1ASP	META	*	ALTA	5,664	46,329,006.60	2.25
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				186,115	706,847,503.29	34.33
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BIL	*	ALTA	85,000	129,237,187.50	6.28
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,849,307,930.11	89.82
PRESTAMO DE VALORES						
1ASP	MSFT	*	ALTA	25,500	177,988,326.56	8.64
OTROS VALORES					312,225	1.53
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,058,871,232.82	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					177,988,326.56	8.64

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA RVESACCINT	VaR Promedio	Límite de VaR
		1.285%	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