

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 25 ABRIL, 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	MSFT	*	ALTA	22,736	156,171,650.17	7.40
1ASP	NVDA	*	ALTA	10,041	142,822,601.14	6.77
1ASP	AMZN	*	ALTA	37,833	113,101,220.51	5.36
1ASP	GOOG	*	ALTA	39,236	106,678,294.28	5.06
1ASP	V	*	ALTA	21,905	103,752,904.93	4.92
1ASP	UNH	*	ALTA	9,096	77,326,082.88	3.66
1ASP	META	*	ALTA	8,494	64,535,193.10	3.06
1ASP	ISRG	*	ALTA	9,915	63,681,451.55	3.02
1ASP	COST	*	ALTA	4,989	61,992,362.58	2.94
1ASP	MNST	*	ALTA	67,541	61,793,452.72	2.93
1ASP	VRTX	*	ALTA	8,909	60,989,666.25	2.89
1ASP	QCOM	*	ALTA	18,451	51,865,408.22	2.46
1ASP	CPRT	*	ALTA	52,952	50,332,728.90	2.39
1ASP	LLY	*	ALTA	3,885	48,475,562.37	2.30
1ASP	ANET	*	ALTA	10,448	47,616,475.15	2.26
1ASP	NFLX	*	ALTA	4,452	43,283,418.18	2.05
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				188,260	641,200,785.23	30.39
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BIL	*	ALTA	79,000	124,782,074.94	5.91
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,020,401,333.10	95.76
PRESTAMO DE VALORES						
1ASP	MSFT	*	ALTA	8,000	54,951,319.55	2.60
OTROS VALORES					34,599,839.69	1.64
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,109,952,492.34	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					54,951,319.55	2.60

	CATEGORÍA RVESACCINT	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 1.338%	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