

GBMfondos

GBM110 GBM 110, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 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	MELI	N	ALTA	550	21,077,896.85	6.77
1ASP	YUMC	*	ALTA	16,600	16,014,430.07	5.14
1ASP	UMG	N	ALTA	30,000	15,212,511.96	4.89
1ASP	SLB	N	ALTA	17,000	15,087,738.77	4.85
1ASP	NKE	*	ALTA	7,000	10,820,930.74	3.48
1ASP	PDD	N	ALTA	4,550	10,439,810.35	3.35
1ASP	NVO	N	ALTA	4,500	9,680,745.83	3.11
1ASP	LULU	*	ALTA	1,250	8,432,404.73	2.71
1ASP	AMZN	*	ALTA	1,750	7,559,495.35	2.43
1ASP	GOLD	N	ALTA	20,000	6,883,595.70	2.21
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				49,500	13,711,379.67	4.40
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	CUERVO	*	ALTA	445,637	11,675,689.40	3.75
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IB01	N	ALTA	69,111	159,885,540.00	51.36
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					306,482,169.42	98.44
OTROS VALORES				49,086	4,845,296.08	1.56
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					311,327,465.50	100.00

CATEGORÍA
ESRV

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.001%

Límite de VaR
3.250%

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