

GBMfondos

GBM112 GBM 112, 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	BRKB	*	ALTA	12,467	119,100,828.65	21.32
1ASP	GOOGL	*	ALTA	5,000	17,932,073.19	3.21
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	GMEXICO	B	ALTA	607,129	62,151,795.73	11.13
1	GFINBUR	O	ALTA	1,067,388	47,189,223.48	8.45
1	Q	*	ALTA	313,646	44,882,742.60	8.04
1	FEMSA	UBD	ALTA	200,000	37,260,000.00	6.67
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,133,279	50,284,483.23	9.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					378,801,146.88	67.82
REPORTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	5,142,694	45,956,223.99	8.23
TOTAL REPORTO					45,956,223.99	8.23
PRESTAMO DE VALORES						
1	FEMSA	UBD	ALTA	300,000	55,890,000.00	10.01
1ISP	SHV	*	ALTA	12,067	27,183,239.66	4.87
1	Q	*	ALTA	111,982	16,024,624.20	2.87
OTROS VALORES				321,137	34,686,694.48	6.21
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					558,541,929.21	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					99,097,863.86	17.74

CATEGORÍA RVESACCLAT

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.023%

Límite de VaR
2.600%

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