

# GBMfondos

## GBM112 GBM 112, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable CARTERA DE VALORES AL 29 FEBRERO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ASP	BRKB	*	ALTA	12,300	85,878,974.17	16.39
1ASP	GOOGL	*	ALTA	5,000	11,806,691.89	2.25
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	GFINBUR	O	ALTA	982,453	50,802,644.63	9.70
1	GMEXICO	B	ALTA	610,000	50,471,400.00	9.63
1	Q	*	ALTA	110,447	21,145,078.15	4.04
1	FEMSA	UBD	ALTA	80,625	17,159,418.75	3.28
1	AC	*	ALTA	63,418	11,644,178.98	2.22
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,074,910	37,027,162.40	7.07
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>285,935,548.97</b>	<b>54.58</b>
<b>REPORTO</b>						
IM	BPAG28	270204	mxAAA	1,025,449	102,753,286.15	19.62
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>102,753,286.15</b>	<b>19.62</b>
<b>PRESTAMO DE VALORES</b>						
1	FEMSA	UBD	ALTA	200,000	42,566,000.00	8.13
1ISP	SHV	*	ALTA	8,000	15,080,094.23	2.88
1	GRUMA	B	ALTA	44,000	13,355,320.00	2.55
1ISP	SHV	*	ALTA	7,000	13,195,082.45	2.52
1	Q	*	ALTA	59,263	11,345,901.35	2.17
<b>OTROS VALORES</b>					<b>421,084</b>	<b>7.56</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>523,847,970.95</b>	<b>100.00</b>
<b>TOTAL PRESTAMO DE VALORES</b>					<b>95,542,398.03</b>	<b>18.24</b>

	<b>CATEGORÍA</b> RVESACCLAT	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b> 0.837%	<b>Límite de VaR</b> 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