

# GBMfondos

## GBM112 GBM 112, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable CARTERA DE VALORES AL 27 JUNIO, 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	12,400	93,122,387.50	17.43
1ASP	GOOGL	*	ALTA	5,000	17,065,878.04	3.19
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	FEMSA	UBD	ALTA	430,625	83,898,668.75	15.70
1	GMEXICO	B	ALTA	610,000	58,590,500.00	10.97
1	GFINBUR	O	ALTA	1,157,789	50,051,218.47	9.37
1	Q	*	ALTA	176,372	34,159,728.96	6.39
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,094,608	40,059,583.92	7.50
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ISP	SHV	*	ALTA	6,933	14,096,535.84	2.64
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>391,044,501.48</b>	<b>73.20</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDEF	270520	mxAAA	733,901	73,217,559.75	13.71
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>73,217,559.75</b>	<b>13.71</b>
<b>PRESTAMO DE VALORES</b>						
1ISP	SHV	*	ALTA	8,067	16,402,243.56	3.07
1	GRUMA	B	ALTA	44,000	14,685,880.00	2.75
<b>OTROS VALORES</b>					<b>312,706</b>	<b>7.28</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>534,224,741.69</b>	<b>100.00</b>
<b>TOTAL PRESTAMO DE VALORES</b>					<b>31,088,123.56</b>	<b>5.82</b>

	<b>CATEGORÍA</b>	
	RVESACCLAT	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Límite de VaR</b>
	0.891%	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