

# GBMfondos

GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>						
EAIM	GBM-INT	0009126		202,799	202,799.00	0.04
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,634,225.63	0.29
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>1,837,024.63</b>	<b>0.32</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
1ISP	MTUM	*	NA	23,000	53,104,349.25	9.33
1ISP	QQQ	*	NA	17,250	65,400,382.13	11.48
1ISP	VB	*	ALTA	22,750	68,462,078.34	12.02
1ISP	VGK	*	ALTA	57,750	61,847,456.34	10.86
1ISP	VGSH	*	NA	500	587,128.50	0.10
1ISP	VIG	*	NA	26,250	60,401,181.09	10.61
1ISP	VIGI	*	NA	29,500	39,157,931.25	6.88
1ISP	VOO	*	NA	16,250	87,077,341.41	15.29
1ISP	VPL	*	ALTA	35,400	46,437,901.43	8.15
1ISP	VSS	*	ALTA	18,800	38,224,373.85	6.71
1ISP	VWO	*	ALTA	52,200	42,025,665.38	7.38
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>562,725,788.97</b>	<b>98.81</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>562,725,788.97</b>	<b>98.81</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADO</b>						
M	BONOS	220609	mxAAA	47,918	4,913,729.09	0.86
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					<b>4,913,729.09</b>	<b>0.86</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>569,476,542.69</b>	<b>100.00</b>

## CATEGORÍA

ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVÉS DE TRACKERS INTERNACIONALES

## CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
1.618%

Límite de VaR  
1.940%

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. Javier Martínez Morodo