

GBMfondos

GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 23 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0009126		232,777	232,777.00	0.03
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,725,140.84	0.20
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,957,917.84	0.23
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	IWMO	N	NA	161,864	214,559,199.11	25.22
1ISP	VEA	*	ALTA	178,912	187,883,843.71	22.08
1ISP	VTI	*	ALTA	81,098	373,747,241.65	43.93
1ISP	VWO	*	ALTA	60,773	62,019,030.34	7.29
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					838,209,314.81	98.52
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					838,209,314.81	98.52
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211118	mxAAA	1,073,655	10,657,915.49	1.25
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					10,657,915.49	1.25
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					850,825,148.14	100.00

CATEGORÍA

ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVÉS DE TRACKERS INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio

1.133%

Límite de VaR

2.750%

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

Ing. Fernando Castro Tapia