

GBMfondos

GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VTI	*	ALTA	92,844	399,394,288.24	44.26
1ISP	IWMO	N	ALTA	182,517	223,123,039.94	24.73
1ISP	VEA	*	ALTA	251,809	209,655,386.50	23.23
1ISP	VWO	*	ALTA	96,490	66,529,553.47	7.37
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					898,702,268.15	99.60
OTROS VALORES				295,612	3,645,143.25	0.40
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					902,347,411.40	100.00

	CATEGORÍA RVESPTKINT	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 0.964%	Límite de VaR 2.790%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas