

GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BKCH	*	ALTA	4,077	5,176,511.35	7.28
1ISP	SKYY	*	ALTA	1,688	4,075,103.36	5.73
1ISP	MILN	*	ALTA	4,286	3,970,223.10	5.58
1ISP	AIQ	*	ALTA	5,057	3,963,421.00	5.57
1ISP	EBIZ	*	ALTA	6,959	3,866,350.25	5.44
1ISP	KWEB	*	ALTA	5,836	3,579,777.79	5.03
1ISP	FINX	*	ALTA	5,373	3,524,054.37	4.96
1ISP	RBOT	N	ALTA	11,289	3,213,275.04	4.52
1ISP	HEAL	N	ALTA	19,497	3,114,296.79	4.38
1ISP	SOCL	*	ALTA	3,611	3,057,295.92	4.30
1ISP	LIT	*	ALTA	3,330	3,042,485.98	4.28
1ISP	NATO	N	ALTA	12,004	3,036,003.30	4.27
1ISP	SNSR	*	ALTA	4,095	2,935,935.27	4.13
1ISP	IH2O	N	ALTA	2,086	2,899,957.96	4.08
1ISP	HERO	*	ALTA	5,972	2,834,923.71	3.99
1ISP	NLR	*	ALTA	1,549	2,804,888.56	3.94
1ISP	IDRV	*	ALTA	4,612	2,757,385.42	3.88
1ISP	BUG	*	ALTA	4,011	2,716,768.53	3.82
1ISP	GNOM	*	ALTA	11,789	2,456,193.59	3.45
1ISP	ICLN	*	ALTA	8,995	2,243,377.12	3.16
1ISP	CTEC	*	ALTA	12,369	1,714,308.96	2.41
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					66,982,537.37	94.20
REPORTO						
M	BONOS	241205	mxAAA	39,220	4,092,033.29	5.75
TOTAL REPORTO					4,092,033.29	5.75
OTROS VALORES				131,309	31,309.10	0.04
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					71,105,879.76	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.772%

Límite de VaR
3.220%

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