

# GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 29 DICIEMBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES EXTRANJERAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ESP	CRGX	US	NULA	12,727	4,998,870.21	7.93
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ISP	RBOT	N	ALTA	16,950	3,781,727.89	6.00
1ISP	AIQ	*	ALTA	6,825	3,610,551.86	5.73
1ISP	MILN	*	ALTA	5,743	3,454,219.07	5.48
1ISP	SKYY	*	ALTA	2,310	3,436,036.81	5.45
1ISP	EBIZ	*	ALTA	9,551	3,433,797.05	5.45
1ISP	SNSR	*	ALTA	5,605	3,357,903.07	5.33
1ISP	SOCL	*	ALTA	4,837	3,313,062.72	5.26
1ISP	BUG	*	ALTA	6,533	3,248,802.40	5.16
1ISP	HEAL	N	ALTA	22,940	2,934,672.08	4.66
1ISP	FINX	*	ALTA	6,652	2,885,876.82	4.58
1ISP	BKCH	*	ALTA	3,566	2,797,653.89	4.44
1ISP	IDRV	*	ALTA	4,606	2,792,233.74	4.43
1ISP	HERO	*	ALTA	8,003	2,738,757.22	4.35
1ISP	IH2O	N	ALTA	2,420	2,572,357.13	4.08
1ISP	YODA	N	ALTA	29,456	2,450,988.04	3.89
1ISP	KWEB	*	ALTA	5,127	2,348,669.47	3.73
1ISP	GNOM	*	ALTA	10,978	2,152,804.01	3.42
1ISP	LIT	*	ALTA	2,446	2,114,025.47	3.35
1ISP	ICLN	*	ALTA	7,418	1,959,612.78	3.11
1ISP	CTEC	*	ALTA	8,808	1,616,213.21	2.56
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>61,998,834.94</b>	<b>98.38</b>
<b>OTROS VALORES</b>				726,252	<b>1,021,573.85</b>	<b>1.62</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>63,020,408.79</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b>	
	RVDIS	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Límite de VaR</b>
	1.950%	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

Lic. Julio Andres Maza Casas