

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
DIRECTO						
ACCIONES EXTRANJERAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ESP	CRGX	US	NULA	12,727	4,998,870.21	7.93
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
11SP	RBOT	N	ALTA	16,950	3,781,727.89	6.00
11SP	AIQ	*	ALTA	6,825	3,610,551.86	5.73
11SP	MILN	*	ALTA	5,743	3,454,219.07	5.48
11SP	SKYY	*	ALTA	2,310	3,436,036.81	5.45
11SP	EBIZ	*	ALTA	9,551	3,433,797.05	5.45
11SP	SNSR	*	ALTA	5,605	3,357,903.07	5.33
11SP	SOCL	*	ALTA	4,837	3,313,062.72	5.26
11SP	BUG	*	ALTA	6,533	3,248,802.40	5.16
11SP	HEAL	N	ALTA	22,940	2,934,672.08	4.66
11SP	FINX	*	ALTA	6,652	2,885,876.82	4.58
11SP	BKCH	*	ALTA	3,566	2,797,653.89	4.44
11SP	IDRV	*	ALTA	4,606	2,792,233.74	4.43
11SP	HERO	*	ALTA	8,003	2,738,757.22	4.35
11SP	IH2O	N	ALTA	2,420	2,572,357.13	4.08
11SP	YODA	N	ALTA	29,456	2,450,988.04	3.89
11SP	KWEB	*	ALTA	5,127	2,348,669.47	3.73
11SP	GNOM	*	ALTA	10,978	2,152,804.01	3.42
11SP	LIT	*	ALTA	2,446	2,114,025.47	3.35
11SP	ICLN	*	ALTA	7,418	1,959,612.78	3.11
11SP	CTEC	*	ALTA	8,808	1,616,213.21	2.56
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					61,998,834.94	98.38
OTROS VALORES				726,252	1,021,573.85	1.62
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					63,020,408.79	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	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