

GBMfondos

GBMRE GBM INVERSIÓN EN ACTIVOS REALES, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ASP	PLD	*	ALTA	239	434,040.52	2.98
1ASP	16	N	ALTA	2,123	392,965.18	2.69
1ASP	AMT	*	ALTA	122	391,859.59	2.69
1ASP	1109	N	ALTA	5,708	385,274.07	2.64
1ASP	VNA	N	ALTA	850	352,462.42	2.42
1ASP	EQIX	*	ALTA	23	302,498.89	2.07
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				7,086	2,438,522.04	16.72
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VNQI	*	ALTA	7,431	5,008,296.67	34.33
1ISP	VNQ	*	ALTA	1,906	2,505,283.49	17.17
1ISP	RWO	*	ALTA	2,654	1,747,583.40	11.98
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					13,958,786.27	95.69
REPORTO						
LF	BONDESF	250619	mxAAA	6,273	629,303.65	4.31
TOTAL REPORTO					629,303.65	4.31
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					14,588,089.92	100.00

CATEGORÍA
RVESFIBR

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.639%

Límite de VaR
3.970%

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