

GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 11 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
EXCEDENTES DE APORTACIONES INICIALES DE MARGEN EN DERIVADOS						
EAIM	GBM-INT	0003848		4,278,914	4,278,914.00	7.53
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BKCH	*	ALTA	4,258	3,061,121.51	5.39
1ISP	AIQ	*	ALTA	5,228	2,934,420.98	5.17
1ISP	SKYY	*	ALTA	1,848	2,917,396.57	5.14
1ISP	EBIZ	*	ALTA	7,248	2,792,363.32	4.92
1ISP	MILN	*	ALTA	4,284	2,717,192.29	4.78
1ISP	LIT	*	ALTA	3,469	2,613,635.63	4.60
1ISP	SOCL	*	ALTA	3,906	2,580,800.44	4.54
1ISP	KWEB	*	ALTA	5,758	2,576,059.64	4.54
1ISP	RBOT	N	ALTA	11,289	2,445,496.33	4.31
1ISP	HEAL	N	ALTA	19,497	2,380,162.37	4.19
1ISP	FINX	*	ALTA	5,391	2,368,451.10	4.17
1ISP	IDRV	*	ALTA	4,606	2,340,017.32	4.12
1ISP	SNSR	*	ALTA	3,968	2,321,110.33	4.09
1ISP	GNOM	*	ALTA	12,279	2,195,775.97	3.87
1ISP	BUG	*	ALTA	4,319	2,078,501.82	3.66
1ISP	YODA	N	ALTA	30,138	2,052,722.81	3.61
1ISP	ICLN	*	ALTA	8,995	2,052,044.46	3.61
1ISP	CTEC	*	ALTA	13,319	2,040,251.30	3.59
1ISP	HERO	*	ALTA	5,972	1,995,507.25	3.51
1ISP	NLR	*	ALTA	1,497	1,965,609.79	3.46
1ISP	IH2O	N	ALTA	1,820	1,890,833.60	3.33
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					54,598,388.83	96.12
REPORTO						
LF	BONDESF	270930	mxAAA	16,549	1,653,875.36	2.91
TOTAL REPORTO					1,653,875.36	2.91
OTROS VALORES				100,411	548,251.81	0.97
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					56,800,516.00	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.615%	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