

GBMfondos

GBMTGLO GBM TRACKERS GLOBALES, S.A. de C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 MARZO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	FDT	*	NA	369	453,435.59	35.29
1ISP	FEX	*	NA	286	468,123.42	36.44
1ISP	FVD	*	NA	250	194,073.05	15.11
1ISP	IFV	*	NA	300	141,216.51	10.99
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,256,848.57	97.82
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,256,848.57	97.82
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	240627	mxAAA	280	27,970.15	2.18
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					27,970.15	2.18
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,284,818.72	100.00

CATEGORÍA ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.444%

Límite de VaR
5.330%

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

Ing. Fernando Castro Tapia