

# GBMfondos

## GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 09 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>						
EAIM	GBM-INT	0009126		231,771	231,771.00	0.03
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,719,711.84	0.20
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>1,951,482.84</b>	<b>0.23</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
1ISP	IWMO	N	NA	157,960	209,530,041.55	24.64
1ISP	VEA	*	ALTA	176,792	186,317,880.03	21.91
1ISP	VTI	*	ALTA	80,141	370,629,422.66	43.59
1ISP	VWO	*	ALTA	59,970	62,914,287.72	7.40
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>829,391,631.96</b>	<b>97.55</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>829,391,631.96</b>	<b>97.55</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	220113	mxAAA	1,923,856	18,896,692.36	2.22
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>18,896,692.36</b>	<b>2.22</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>850,239,807.16</b>	<b>100.00</b>

### CATEGORÍA

ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVÉS DE TRACKERS INTERNACIONALES

### CALIFICACIÓN

### VaR Promedio

1.185%

### Límite de VaR

2.750%

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