

# GBMfondos

GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0009126		237,632	237,632.00	0.03
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,762,838.89	0.25
TOTAL DISPONIBILIDADES					2,000,470.89	0.28
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	MTUM	*	NA	19,759	67,606,489.24	9.43
1ISP	QQQ	*	NA	16,010	113,101,807.84	15.77
1ISP	VB	*	ALTA	20,649	93,938,930.05	13.10
1ISP	VGK	*	ALTA	29,311	41,390,420.55	5.77
1ISP	VIG	*	NA	41,736	130,610,114.60	18.21
1ISP	VIGI	*	NA	28,779	52,013,201.15	7.25
1ISP	VOO	*	NA	3,297	26,166,667.88	3.65
1ISP	VPL	*	ALTA	28,055	48,018,807.68	6.70
1ISP	VSS	*	ALTA	17,572	49,145,592.41	6.85
1ISP	VWO	*	ALTA	42,878	47,435,396.28	6.61
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					669,427,427.68	93.34
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					669,427,427.68	93.34
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	221110	mxAAA	4,971	495,721.66	0.07
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					495,721.66	0.07
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ISP	VOO	*	NA	5,700	45,238,097.34	6.31
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					45,238,097.34	6.31
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					717,161,717.57	100.00

CATEGORÍA

ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVES DE TRACKERS INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
1.323%

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