

GBMfondos

DYNVAL FONDO SHERPA-HKE DYNAMIC, S.A. de C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 28 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
REPORTO						
BI	CETES	260611	mxAAA	96,785	832,222.67	98.80
TOTAL REPORTO					832,222.67	98.80
OTROS VALORES				200	10,080.00	1.20
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					842,302.67	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.015%	3.720%

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