

GBMfondos

GBMPIC T GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 07 MARZO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	QUAL	*	ALTA	22,170	61,158,227.62	15.52
1ISP	IEI	*	ALTA	19,790	38,795,033.21	9.84
1ISP	FLRN	*	ALTA	64,665	33,493,551.02	8.50
1ISP	LQD	*	ALTA	17,575	32,271,239.96	8.19
1ISP	FLTR	*	ALTA	74,825	32,042,140.65	8.13
1ISP	FLOR	*	ALTA	35,075	30,075,670.46	7.63
1ISP	VGT	*	ALTA	2,520	22,533,029.97	5.72
1ISP	EMLC	*	ALTA	51,765	21,625,906.50	5.49
1ISP	VOX	*	ALTA	9,980	21,499,855.92	5.45
1ISP	HEWJ	*	ALTA	28,750	19,890,495.45	5.05
1ISP	VCR	*	ALTA	3,575	18,764,702.60	4.76
1ISP	FEZ	*	ALTA	18,335	16,151,506.49	4.10
1ISP	IAU	*	ALTA	17,530	12,071,837.81	3.06
OTROS TIPO DE VALOR 1ISP - TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				24,062	31,867,135.49	8.08
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					392,240,333.15	99.51
OTROS VALORES				19,300	1,927,611.04	0.49
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					394,167,944.19	100.00

CATEGORÍA	Calificación	VaR Promedio	Límite de VaR
RVDIS		0.813%	2.120%

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