

GBMfondos

GBMPIC T GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 29 FEBRERO, 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 | 60,600,879.23 | 15.31 |
| 1ISP | IEI | * | ALTA | 19,790 | 39,012,156.37 | 9.86 |
| 1ISP | FLRN | * | ALTA | 64,665 | 33,977,770.50 | 8.59 |
| 1ISP | FLTR | * | ALTA | 74,825 | 32,489,200.42 | 8.21 |
| 1ISP | LQD | * | ALTA | 17,575 | 32,268,858.86 | 8.15 |
| 1ISP | FLOT | * | ALTA | 35,075 | 30,543,048.97 | 7.72 |
| 1ISP | EMLC | * | ALTA | 56,655 | 23,952,379.78 | 6.05 |
| 1ISP | VGT | * | ALTA | 2,520 | 22,252,975.91 | 5.62 |
| 1ISP | VOX | * | ALTA | 9,980 | 21,770,526.82 | 5.50 |
| 1ISP | HEWJ | * | ALTA | 28,750 | 19,705,604.11 | 4.98 |
| 1ISP | VCR | * | ALTA | 3,575 | 19,250,390.74 | 4.86 |
| 1ISP | FEZ | * | ALTA | 18,335 | 15,856,539.84 | 4.01 |
| 1ISP | IAU | * | ALTA | 17,530 | 11,554,876.62 | 2.92 |
| OTROS TIPO DE VALOR 1ISP - TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | 24,062 | 31,849,728.29 | 8.05 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 395,084,936.46 | 99.84 |
| OTROS VALORES | | | | 6,316 | 629,454.92 | 0.16 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 395,714,391.38 | 100.00 |

| | | |
|---------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| | CATEGORÍA RVDIS | |
| CALIFICACIÓN | VaR Promedio 0.824% | Límite de VaR 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