

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 16 MAYO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	233,177	96,545,135.79	26.29
1ISP	VNRA	N	ALTA	41,149	89,497,967.43	24.37
1ISP	VDEA	N	ALTA	44,170	39,862,779.23	10.85
1ISP	VDPA	N	ALTA	43,124	39,670,537.84	10.80
1ISP	VWCG	N	ALTA	45,984	38,070,969.08	10.37
1ISP	VDTA	N	ALTA	51,488	21,573,735.16	5.87
1ISP	VFEA	N	ALTA	18,839	19,267,797.46	5.25
1ISP	VJPA	N	ALTA	26,579	14,408,922.29	3.92
1ISP	VAPU	N	ALTA	14,633	7,711,269.98	2.10
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					366,609,114.26	99.83
OTROS VALORES				6,285	630,994.79	0.17
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					367,240,109.05	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.878%	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