

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	225,704	102,686,439.90	26.30
1ISP	VNRA	N	ALTA	39,890	97,977,913.10	25.09
1ISP	VDPA	N	ALTA	41,576	42,172,013.33	10.80
1ISP	VDEA	N	ALTA	42,419	41,770,492.81	10.70
1ISP	VWCG	N	ALTA	44,708	39,274,594.20	10.06
1ISP	VDTA	N	ALTA	49,494	22,895,684.11	5.86
1ISP	VFEA	N	ALTA	18,144	20,132,702.44	5.16
1ISP	VJPA	N	ALTA	25,714	15,307,730.40	3.92
1ISP	VAPU	N	ALTA	14,008	7,933,061.18	2.03
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					390,150,631.47	99.92
OTROS VALORES				3,184	316,792.53	0.08
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					390,467,424.00	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.840%	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