

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 25 JULIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	227,128	105,446,986.75	27.19
1ISP	VNRA	N	ALTA	37,340	92,010,744.74	23.72
1ISP	VDPA	N	ALTA	41,744	43,089,294.57	11.11
1ISP	VDEA	N	ALTA	42,781	43,007,172.54	11.09
1ISP	VWCG	N	ALTA	43,146	38,587,266.86	9.95
1ISP	VDTA	N	ALTA	49,943	23,534,548.24	6.07
1ISP	VFEA	N	ALTA	17,200	19,080,962.55	4.92
1ISP	VJPA	N	ALTA	25,545	15,284,060.64	3.94
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					380,041,036.89	97.99
OTROS VALORES				15,122	7,793,731.16	2.01
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					387,834,768.05	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.924%	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 período 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