

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 AGOSTO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	242,542	122,693,950.98	26.94
1ISP	VNRA	N	ALTA	39,750	107,718,896.98	23.65
1ISP	VDPA	N	ALTA	44,394	50,381,663.83	11.06
1ISP	VDEA	N	ALTA	45,497	50,297,775.06	11.04
1ISP	VWCG	N	ALTA	45,875	46,142,122.56	10.13
1ISP	VDTA	N	ALTA	52,792	27,251,797.39	5.98
1ISP	VFEA	N	ALTA	18,138	22,038,858.20	4.84
1ISP	VJPA	N	ALTA	27,164	18,366,868.16	4.03
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					444,891,933.16	97.68
OTROS VALORES				27,158	10,549,795.73	2.32
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					455,441,728.89	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.876%	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