

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 05 SEPTIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	278,842	143,586,356.57	27.21
1ISP	VNRA	N	ALTA	45,750	122,976,116.57	23.30
1ISP	VDPA	N	ALTA	50,994	58,859,851.93	11.15
1ISP	VDEA	N	ALTA	52,297	58,696,043.03	11.12
1ISP	VWCG	N	ALTA	52,775	52,442,511.64	9.94
1ISP	VDTA	N	ALTA	60,040	31,581,052.13	5.98
1ISP	VFEA	N	ALTA	21,040	25,480,621.77	4.83
1ISP	VJPA	N	ALTA	31,164	20,929,804.76	3.97
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					514,552,358.40	97.51
OTROS VALORES				41,464	13,161,430.07	2.49
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					527,713,788.47	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.883%	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