

gbmfondos

GBMPICT GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	AAXJ	*	ALTA	52,375	72,785,602.97	4.30
1ISP	BIL	*	ALTA	4,750	8,211,385.44	0.48
1ISP	EMB	*	ALTA	72,960	158,034,511.87	9.33
1ISP	EMLC	*	NA	82,405	52,990,047.00	3.13
1ISP	EWQ	*	ALTA	162,200	100,314,913.52	5.92
1ISP	EWU	*	ALTA	53,230	34,319,816.27	2.03
1ISP	EXI	*	NA	19,310	35,517,300.10	2.10
1ISP	EZU	*	ALTA	178,035	141,110,968.28	8.33
1ISP	FLRN	*	NA	370,975	215,546,667.54	12.73
1ISP	HEWJ	*	NA	132,820	82,797,368.13	4.89
1ISP	IAU	*	ALTA	166,308	45,594,793.40	2.69
1ISP	IDU	*	ALTA	17,045	52,225,204.59	3.08
1ISP	IXG	*	NA	39,985	51,976,126.64	3.07
1ISP	PICK	*	NA	32,785	18,429,103.38	1.09
1ISP	QQQ	*	NA	10,045	40,380,132.31	2.38
1ISP	TIP	*	ALTA	92,655	204,216,000.27	12.06
1ISP	VCR	*	ALTA	13,925	49,887,608.92	2.95
1ISP	VGT	*	ALTA	7,985	36,966,568.48	2.18
1ISP	VHT	*	ALTA	16,640	60,325,392.19	3.56
1ISP	VNO	*	ALTA	40,148	70,436,732.18	4.16
1ISP	VWO	*	ALTA	113,385	95,335,981.69	5.63
1ISP	XLE	*	ALTA	14,545	16,511,575.63	0.97
1ISP	XLP	*	ALTA	23,705	28,227,780.07	1.67
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,672,141,580.87	98.72
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,672,141,580.87	98.72
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
M	BONOS	231207	mxAAA	206,050	21,707,528.49	1.28
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					21,707,528.49	1.28
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,693,849,109.36	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.793%

Límite de VaR
2.510%

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. Raymundo Leal Vargas