

GBMfondos

GBMPIC T GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0004309		1,026	1,026.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,026.00	0.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	BIL	*	ALTA	92,305	169,480,045.15	9.07
1ISP	EMB	*	ALTA	23,885	54,376,297.81	2.91
1ISP	ERTH	*	NA	23,005	31,061,624.18	1.66
1ISP	EWL	*	ALTA	38,205	38,997,375.52	2.09
1ISP	EZU	*	ALTA	72,595	74,086,052.30	3.96
1ISP	FDN	*	NA	17,160	85,922,311.76	4.60
1ISP	FLRN	*	NA	294,160	180,959,760.34	9.68
1ISP	HEZU	*	NA	51,760	38,783,369.45	2.08
1ISP	IAU	*	ALTA	25,920	17,969,715.86	0.96
1ISP	ICLN	*	NA	51,500	24,123,015.86	1.29
1ISP	IEI	*	ALTA	65,385	172,392,606.76	9.22
1ISP	INDA	*	NA	17,905	17,471,099.18	0.93
1ISP	IWD	*	NA	15,345	50,246,273.74	2.69
1ISP	KRE	*	NA	12,500	16,536,330.94	0.88
1ISP	LQD	*	ALTA	36,735	99,790,104.03	5.34
1ISP	QQQ	*	NA	14,510	110,688,753.27	5.92
1ISP	QUAL	*	NA	33,135	93,969,099.70	5.03
1ISP	SMH	*	NA	9,555	51,956,166.00	2.78
1ISP	TIP	*	ALTA	22,330	58,099,159.21	3.11
1ISP	TLT	*	ALTA	23,360	69,802,817.83	3.73
1ISP	VCR	*	ALTA	5,220	33,635,972.28	1.80
1ISP	VHT	*	ALTA	17,525	92,359,255.64	4.94
1ISP	VIS	*	ALTA	4,190	16,758,486.47	0.90
1ISP	VNQ	*	ALTA	33,900	73,902,506.81	3.95
1ISP	VTWO	*	NA	7,020	12,854,097.36	0.69
1ISP	XLB	*	ALTA	32,150	55,260,538.02	2.96
1ISP	XLC	*	NA	30,325	52,129,753.05	2.79
1ISP	XLE	*	ALTA	15,320	14,887,225.32	0.80
1ISP	XLF	*	ALTA	71,220	54,908,910.72	2.94
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,863,408,724.56	99.70
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,863,408,724.56	99.70
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	220113	mxAAA	574,888	5,640,272.65	0.30
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					5,640,272.65	0.30
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,869,050,023.21	100.00

	CATEGORÍA	
	DISCRECIONAL	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.949%	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

Ing. Fernando Castro Tapia