

GBMfondos

GBMPICT GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	QUAL	*	ALTA	27,370	64,057,594.28	13.46
1ISP	IEI	*	ALTA	22,660	45,865,729.73	9.64
1ISP	FLOT	*	ALTA	42,890	39,343,755.94	8.27
1ISP	FLRN	*	ALTA	70,555	39,031,209.09	8.20
1ISP	FLTR	*	ALTA	81,010	36,856,602.86	7.75
1ISP	EMLC	*	ALTA	81,685	34,896,187.33	7.33
1ISP	LQD	*	ALTA	19,000	33,964,187.87	7.14
1ISP	BIL	*	ALTA	15,752	26,071,157.41	5.48
1ISP	VOX	*	ALTA	13,925	25,984,046.66	5.46
1ISP	VGX	*	ALTA	3,500	25,727,796.15	5.41
1ISP	VCR	*	ALTA	4,925	22,670,621.78	4.76
1ISP	IAU	*	ALTA	19,440	13,172,126.91	2.77
1ISP	HEWJ	*	ALTA	20,210	12,440,686.37	2.61
1ISP	XLE	*	ALTA	7,665	11,770,315.32	2.47
1ISP	QQQ	*	ALTA	1,800	11,384,292.93	2.39
1ISP	VWO	*	ALTA	15,240	10,422,445.04	2.19
1ISP	AAXJ	*	ALTA	9,345	10,344,409.95	2.17
OTROS TIPO DE VALOR 1ISP - TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				4,460	10,283,817.23	2.16
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					474,286,982.85	99.68
OTROS VALORES				15,243	1,529,168.75	0.32
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					475,816,151.60	100.00

	CATEGORIA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.937%	2.140%

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. Julio Andres Maza Casas