

GBMfondos

GBM PICT GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 23 NOVIEMBRE, 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	66,417,956.50	14.59	
1ISP	IEI	*	ALTA	22,113	43,432,035.43	9.54	
1ISP	FLOT	*	ALTA	42,890	37,445,751.97	8.22	
1ISP	FLRN	*	ALTA	70,555	37,185,039.23	8.17	
1ISP	FLTR	*	ALTA	81,010	35,091,947.44	7.71	
1ISP	EMLC	*	ALTA	81,685	34,906,936.42	7.67	
1ISP	LQD	*	ALTA	19,000	34,378,368.62	7.55	
1ISP	VCR	*	ALTA	4,925	23,996,670.79	5.27	
1ISP	VOX	*	ALTA	12,250	23,973,829.98	5.27	
1ISP	BIL	*	ALTA	14,427	22,753,614.82	5.00	
1ISP	HEWJ	*	ALTA	20,210	12,461,375.63	2.74	
1ISP	IAU	*	ALTA	18,962	12,278,577.61	2.70	
OTROS TIPO DE VALOR 1ISP - TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				25,240	39,299,495.41	8.63	
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					423,621,599.85	93.04	
PRESTAMO DE VALORES							
1ISP	VGJ	*	ALTA	3,136	24,811,189.43	5.45	
OTROS VALORES					13,080	6,857,046.53	1.51
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					455,289,835.81	100.00	
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					24,811,189.43	5.45	

	CATEGORÍA RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 0.898%	Límite de VaR 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