

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 11 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	261,982	105,560,024.77	27.79
1ISP	VNRA	N	ALTA	25,473	52,819,940.60	13.91
1ISP	VWCG	N	ALTA	58,601	44,897,984.77	11.82
1ISP	VDEA	N	ALTA	48,105	41,841,398.04	11.02
1ISP	VDPA	N	ALTA	44,672	39,780,526.79	10.47
1ISP	VFEA	N	ALTA	36,259	34,553,350.53	9.10
1ISP	VDTA	N	ALTA	55,958	22,714,925.18	5.98
1ISP	VJPA	N	ALTA	35,022	18,932,194.16	4.98
1ISP	VAPU	N	ALTA	30,453	15,030,781.01	3.96
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					376,131,125.85	99.02
OTROS VALORES				18,618	3,712,839.22	0.98
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					379,843,965.07	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.815%	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 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