

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 05 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	378,922	198,784,243.19	26.45
1ISP	VNRA	N	ALTA	63,200	192,353,987.53	25.59
1ISP	VDEA	N	ALTA	70,726	81,787,059.10	10.88
1ISP	VDPA	N	ALTA	69,110	80,944,622.46	10.77
1ISP	VWCG	N	ALTA	72,805	71,544,500.90	9.52
1ISP	VDTA	N	ALTA	82,859	43,602,145.34	5.80
1ISP	VFEA	N	ALTA	27,144	35,214,402.59	4.69
1ISP	VJPA	N	ALTA	43,179	29,648,563.93	3.94
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					733,879,525.04	97.65
OTROS VALORES				49,005	17,678,579.95	2.35
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					751,558,104.99	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.972%

Límite de VaR
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