

GBMfondos

GBMPICT GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 29 DICIEMBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	QUAL	*	ALTA	24,640	61,512,910.51	14.99
1ISP	IEI	*	ALTA	19,790	39,328,624.61	9.58
1ISP	FLOT	*	ALTA	39,520	33,941,724.02	8.27
1ISP	FLRN	*	ALTA	64,665	33,561,671.33	8.18
1ISP	LQD	*	ALTA	17,575	32,997,483.53	8.04
1ISP	EMLC	*	ALTA	75,305	32,388,929.76	7.89
1ISP	FLTR	*	ALTA	74,825	31,928,575.00	7.78
1ISP	VGX	*	ALTA	2,890	23,732,201.42	5.78
1ISP	VOX	*	ALTA	11,315	22,600,367.24	5.51
1ISP	VCR	*	ALTA	4,150	21,443,788.82	5.22
1ISP	BIL	*	ALTA	9,212	14,283,920.61	3.48
1ISP	IAU	*	ALTA	17,530	11,608,478.16	2.83
1ISP	QQQ	*	ALTA	1,610	11,186,540.87	2.73
1ISP	HEWJ	*	ALTA	18,450	10,928,008.91	2.66
OTROS TIPO DE VALOR 1ISP - TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				21,960	26,376,362.89	6.43
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					407,819,587.68	99.35
OTROS VALORES				26,703	2,668,858.79	0.65
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					410,488,446.47	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.865%	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