

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	374,598	191,542,641.68	27.03
1ISP	VNRA	N	ALTA	61,571	173,848,057.58	24.54
1ISP	VDEA	N	ALTA	68,726	77,262,618.79	10.90
1ISP	VDPA	N	ALTA	67,210	76,708,230.18	10.83
1ISP	VWCG	N	ALTA	70,605	68,291,051.81	9.64
1ISP	VDTA	N	ALTA	80,716	41,668,116.97	5.88
1ISP	VFEA	N	ALTA	26,367	33,900,060.47	4.78
1ISP	VJPA	N	ALTA	41,879	27,146,096.70	3.83
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					690,366,874.18	97.43
OTROS VALORES				77,856	18,179,127.03	2.57
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					708,546,001.21	100.00

CATEGORÍA		
RVDIS		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.999%	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