

GBMfondos

GBMPICIT GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0004309		1,018	1,018.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,018.00	0.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ISP	NOBL	*	NA	22,025	39,792,766.83	2.43
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	AAXJ	*	ALTA	8,545	16,097,562.34	0.98
1ISP	BIL	*	ALTA	44,900	81,873,104.81	5.01
1ISP	EMB	*	ALTA	21,935	49,175,859.34	3.01
1ISP	ERTH	*	NA	23,005	31,740,029.56	1.94
1ISP	EWJ	*	ALTA	12,140	16,345,416.19	1.00
1ISP	EWL	*	ALTA	81,805	79,304,961.49	4.85
1ISP	FDN	*	NA	17,160	83,762,835.16	5.12
1ISP	FLRN	*	NA	294,160	179,734,039.74	11.00
1ISP	HEWG	*	NA	62,965	41,873,714.69	2.56
1ISP	HEZU	*	NA	233,885	169,901,407.99	10.39
1ISP	IAU	*	ALTA	23,165	15,567,085.01	0.95
1ISP	ICLN	*	NA	51,500	24,085,267.65	1.47
1ISP	IEI	*	ALTA	65,385	170,139,325.24	10.41
1ISP	INDA	*	NA	17,905	15,794,425.74	0.97
1ISP	IWD	*	NA	15,345	48,522,266.45	2.97
1ISP	IXG	*	NA	9,820	15,193,065.54	0.93
1ISP	KRE	*	NA	12,500	16,329,256.88	1.00
1ISP	LQD	*	ALTA	27,420	73,443,554.17	4.49
1ISP	QQQ	*	NA	4,965	35,080,515.58	2.15
1ISP	SMH	*	NA	9,555	49,951,193.29	3.06
1ISP	TIP	*	ALTA	22,330	56,983,465.89	3.49
1ISP	VCR	*	ALTA	5,220	32,676,100.41	2.00
1ISP	VHT	*	ALTA	5,150	25,371,663.23	1.55
1ISP	VIS	*	ALTA	4,190	16,409,006.84	1.00
1ISP	VNQ	*	ALTA	37,830	76,764,017.48	4.70
1ISP	VVO	*	ALTA	44,890	48,601,049.57	2.97
1ISP	XLB	*	ALTA	9,320	15,292,720.60	0.94
1ISP	XLC	*	NA	30,325	48,948,703.01	2.99
1ISP	XLE	*	ALTA	15,320	16,452,124.25	1.01
1ISP	XLF	*	ALTA	43,665	31,937,242.52	1.95
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,623,143,747.49	99.31
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,623,143,747.49	99.31
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	230810	mxAAA	113,812	11,357,908.07	0.69
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					11,357,908.07	0.69
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,634,502,673.56	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.000%

Límite de VaR
2.510%

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 período 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

Ing. Fernando Castro Tapia