

GBMfondos

GBMPIC T GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 10 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		1,006	1,006.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,006.00	0.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ISP	NOBL	*	NA	39,895	72,589,122.45	4.53
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	AAXJ	*	ALTA	17,580	32,800,668.36	2.05
1ISP	BIL	*	ALTA	44,900	80,899,745.09	5.04
1ISP	EMB	*	ALTA	21,935	48,725,168.80	3.04
1ISP	ERTH	*	NA	23,005	34,457,715.34	2.15
1ISP	EWJ	*	ALTA	12,140	16,447,617.26	1.03
1ISP	EWL	*	ALTA	72,380	70,716,765.50	4.41
1ISP	FDN	*	NA	14,230	65,419,809.81	4.08
1ISP	FLRN	*	NA	294,160	177,597,246.79	11.07
1ISP	HEWVG	*	NA	62,965	41,375,893.26	2.58
1ISP	HEZU	*	NA	203,395	146,236,326.92	9.12
1ISP	IAU	*	ALTA	23,165	16,499,958.79	1.03
1ISP	ICLN	*	NA	38,000	16,722,026.16	1.04
1ISP	IEI	*	ALTA	65,385	169,082,565.67	10.54
1ISP	ITB	*	ALTA	17,205	22,865,858.95	1.43
1ISP	IWD	*	NA	22,830	72,191,198.23	4.50
1ISP	IXG	*	NA	9,820	15,378,031.62	0.96
1ISP	KRE	*	NA	23,160	31,204,468.51	1.95
1ISP	LQD	*	ALTA	24,390	64,166,794.42	4.00
1ISP	SMH	*	NA	6,415	31,666,485.10	1.97
1ISP	TIP	*	ALTA	22,330	56,301,611.52	3.51
1ISP	VCR	*	ALTA	3,065	18,369,505.82	1.15
1ISP	VHT	*	ALTA	5,150	24,880,327.12	1.55
1ISP	VIS	*	ALTA	8,175	31,861,623.34	1.99
1ISP	VNQ	*	ALTA	37,830	78,615,998.37	4.90
1ISP	VWO	*	ALTA	51,520	55,714,768.70	3.47
1ISP	XLB	*	ALTA	9,320	15,751,623.89	0.98
1ISP	XLC	*	NA	10,485	16,464,853.01	1.03
1ISP	XLE	*	ALTA	30,240	33,101,244.09	2.06
1ISP	XLF	*	ALTA	53,495	39,325,745.11	2.45
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,597,430,768.00	99.60
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,597,430,768.00	99.60
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDES	231221	mxAAA	63,983	6,381,281.43	0.40
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					6,381,281.43	0.40
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,603,813,055.43	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.015%

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 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

Ing. Fernando Castro Tapia