

# GBMfondos

## GBM PICT GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>						
EAIM	GBM-INT	0004309		1,015	1,015.00	0.00
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>1,015.00</b>	<b>0.00</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
1ISP	BIL	*	ALTA	106,435	193,389,662.28	10.13
1ISP	EMB	*	ALTA	23,885	53,743,820.62	2.82
1ISP	ERTH	*	NA	23,005	29,956,685.18	1.57
1ISP	EWL	*	ALTA	38,205	37,414,858.13	1.96
1ISP	EZU	*	ALTA	72,595	72,925,405.98	3.82
1ISP	FDN	*	NA	17,160	84,219,853.49	4.41
1ISP	FLRN	*	NA	294,160	179,017,585.11	9.38
1ISP	HEWJ	*	NA	41,990	34,756,034.60	1.82
1ISP	HEZU	*	NA	51,760	38,163,685.01	2.00
1ISP	IAU	*	ALTA	25,920	17,592,110.32	0.92
1ISP	ICLN	*	NA	59,900	26,849,178.26	1.41
1ISP	IEI	*	ALTA	65,385	170,481,138.73	8.93
1ISP	INDA	*	NA	17,905	17,744,585.17	0.93
1ISP	IWD	*	NA	15,345	49,107,365.08	2.57
1ISP	KRE	*	NA	12,500	15,872,447.94	0.83
1ISP	LQD	*	ALTA	36,735	99,152,750.86	5.19
1ISP	QQQ	*	NA	14,510	108,988,766.03	5.71
1ISP	QUAL	*	NA	33,135	91,456,974.48	4.79
1ISP	SMH	*	NA	9,555	52,294,295.33	2.74
1ISP	TIP	*	ALTA	22,330	57,356,830.85	3.01
1ISP	TLT	*	ALTA	23,360	69,888,418.33	3.66
1ISP	VCR	*	ALTA	5,220	33,193,528.08	1.74
1ISP	VHT	*	ALTA	17,525	89,980,671.42	4.71
1ISP	VIS	*	ALTA	4,690	18,155,827.35	0.95
1ISP	VNQ	*	ALTA	33,900	72,250,866.43	3.79
1ISP	VTWO	*	NA	7,020	12,515,259.55	0.66
1ISP	XLB	*	ALTA	32,150	53,624,932.49	2.81
1ISP	XLC	*	NA	30,325	50,701,406.89	2.66
1ISP	XLE	*	ALTA	15,320	15,298,411.21	0.80
1ISP	XLF	*	ALTA	71,220	53,573,208.82	2.81
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>1,899,666,564.02</b>	<b>99.53</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>1,899,666,564.02</b>	<b>99.53</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	211118	mxAAA	910,871	9,033,953.33	0.47
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>9,033,953.33</b>	<b>0.47</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>1,908,701,532.35</b>	<b>100.00</b>

### CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
0.923%

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