

GBMfondos

HEYG GBM 111, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	SPY	*	ALTA	2,778	31,986,500.80	44.01
1ISP	VCR	*	ALTA	998	6,813,091.88	9.37
1ISP	VEA	*	ALTA	6,144	6,465,804.61	8.90
1ISP	XLP	*	ALTA	3,578	5,870,777.26	8.08
1ISP	XLV	*	ALTA	1,545	4,547,762.10	6.26
1ISP	IDU	*	ALTA	2,122	4,291,790.16	5.91
1ISP	XLF	*	ALTA	3,971	4,045,951.80	5.57
1ISP	XLI	*	ALTA	1,481	3,996,110.79	5.50
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					68,017,779.40	93.58
REPORTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	497,150	4,662,677.40	6.42
TOTAL REPORTO					4,662,677.40	6.42
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					72,680,456.80	100.00

CATEGORÍA RVESACC	CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
		1.249%	3.020%

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