

GBMfondos

HEYG GBM 111, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 30 AGOSTO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	SPY	*	ALTA	1,759	19,535,485.55	40.77
1ISP	VEA	*	ALTA	3,939	4,065,932.12	8.49
1ISP	VCR	*	ALTA	639	4,035,480.81	8.42
1ISP	XLP	*	ALTA	2,294	3,729,286.47	7.78
1ISP	XLV	*	ALTA	950	2,942,401.22	6.14
1ISP	XLI	*	ALTA	921	2,385,497.70	4.98
1ISP	XLF	*	ALTA	2,546	2,294,459.01	4.79
1ISP	IDU	*	ALTA	1,174	2,249,718.12	4.70
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					41,238,261.00	86.07
REPORTO						
LF	BONDEF	250703	mxAAA	66,729	6,675,544.91	13.93
TOTAL REPORTO					6,675,544.91	13.93
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					47,913,805.91	100.00

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.874%

Límite de VaR
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