

gbmfondos

GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 12 FEBRERO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VTI	*	ALTA	151,596	876,557,555.00	47.83
1ISP	IWMO	N	ALTA	263,626	452,478,654.61	24.69
1ISP	VEA	*	ALTA	312,822	368,746,878.18	20.12
1ISP	VWO	*	ALTA	134,180	133,369,174.95	7.28
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,831,152,262.74	99.91
OTROS VALORES				197,708	1,630,681.16	0.09
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,832,782,943.90	100.00

CATEGORÍA
RVESPTKINT

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.218%

Límite de VaR
2.790%

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