

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, 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	VAGU	N	ALTA	447,693	209,242,818.81	24.72
1ISP	VNRA	N	ALTA	55,417	164,140,155.83	19.39
1ISP	VWCG	N	ALTA	112,054	128,866,287.68	15.22
1ISP	VDPA	N	ALTA	102,309	108,792,921.88	12.85
1ISP	VDEA	N	ALTA	68,971	75,271,964.89	8.89
1ISP	VFEA	N	ALTA	35,089	51,207,425.56	6.05
1ISP	VDTA	N	ALTA	88,324	41,630,464.22	4.92
1ISP	VAPU	N	ALTA	44,496	37,420,001.71	4.42
1ISP	VJPA	N	ALTA	34,075	28,028,783.79	3.31
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					844,600,824.37	99.78
OTROS VALORES				204,169	1,869,282.10	0.22
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					846,470,106.47	100.00

CATEGORÍA		
RVDIS		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.862%	2.120%

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