

# gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 30 ENERO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	449,988	211,452,600.21	24.82
1ISP	VNRA	N	ALTA	55,702	168,566,493.74	19.79
1ISP	VWCG	N	ALTA	112,629	129,708,378.16	15.23
1ISP	VDPA	N	ALTA	102,834	109,875,995.61	12.90
1ISP	VDEA	N	ALTA	69,321	75,811,794.06	8.90
1ISP	VFEA	N	ALTA	35,089	50,966,349.26	5.98
1ISP	VDTA	N	ALTA	88,324	41,814,883.15	4.91
1ISP	VAPU	N	ALTA	44,496	36,477,371.66	4.28
1ISP	VJPA	N	ALTA	33,622	25,647,741.79	3.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					850,321,607.64	99.81
OTROS VALORES				119,700	1,605,404.77	0.19
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					851,927,012.41	100.00

CATEGORÍA  
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
0.886%

Límite de VaR  
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