

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 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	425,293	200,766,008.52	23.20
1ISP	VNRA	N	ALTA	55,617	165,512,402.26	19.12
1ISP	VWCG	N	ALTA	112,054	131,879,931.60	15.24
1ISP	VDPA	N	ALTA	102,309	109,464,460.15	12.65
1ISP	VDEA	N	ALTA	68,971	75,932,912.19	8.77
1ISP	VFEA	N	ALTA	35,089	51,570,311.09	5.96
1ISP	VDTA	N	ALTA	88,324	42,072,134.66	4.86
1ISP	VAPU	N	ALTA	44,496	40,572,373.73	4.69
1ISP	VJPA	N	ALTA	33,918	27,804,613.07	3.21
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					845,575,147.27	97.69
OTROS VALORES				852,770	19,955,274.09	2.31
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					865,530,421.36	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.841%

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