

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 JULIO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	609,795	283,222,074.51	28.75
1ISP	VNRA	N	ALTA	51,639	167,525,545.39	17.01
1ISP	VWCG	N	ALTA	92,800	111,687,476.35	11.34
1ISP	VDEA	N	ALTA	80,336	87,690,802.09	8.90
1ISP	VFEA	N	ALTA	46,244	69,156,479.44	7.02
1ISP	VDPA	N	ALTA	64,943	68,313,764.58	6.94
1ISP	VITS	N	ALTA	28,401	49,115,041.86	4.99
1ISP	VJPA	N	ALTA	47,770	39,074,429.62	3.97
1ISP	VUDS	N	ALTA	22,210	39,036,696.49	3.96
1ISP	VLDS	N	ALTA	22,548	38,508,924.73	3.91
1ISP	VAPU	N	ALTA	30,037	28,312,650.74	2.87
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					981,643,885.80	99.66
OTROS VALORES				205,988	3,393,491.37	0.34
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					985,037,377.17	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.676%

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