

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 13 AGOSTO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	618,000	283,854,534.81	28.45
1ISP	VNRA	N	ALTA	52,114	174,368,305.14	17.48
1ISP	VWCG	N	ALTA	93,653	112,958,646.93	11.32
1ISP	VDEA	N	ALTA	81,000	88,144,356.74	8.83
1ISP	VFEA	N	ALTA	46,669	70,439,245.47	7.06
1ISP	VDPA	N	ALTA	65,000	67,794,128.42	6.79
1ISP	VITS	N	ALTA	28,401	48,672,751.10	4.88
1ISP	VJPA	N	ALTA	48,819	41,917,525.24	4.20
1ISP	VLDS	N	ALTA	23,000	39,004,114.33	3.91
1ISP	VUDS	N	ALTA	22,346	38,810,021.19	3.89
1ISP	VAPU	N	ALTA	30,695	30,540,793.78	3.06
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					996,504,423.15	99.87
OTROS VALORES				140,254	1,287,051.49	0.13
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					997,791,474.64	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.675%

Limite 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