GBMfondos

GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VUAA	N	ALTA	481,000	1,298,267,977.34	48.05
1ISP	IWMO	N	ALTA	314,000	676,231,683.63	25.03
1ISP	VWCG	N	ALTA	245,000	297,593,695.28	11.01
1ISP	VFEA	N	ALTA	121,000	191,452,347.77	7.09
1ISP	VAPU	N	ALTA	118,000	124,726,421.02	4.62
1ISP	VJPA	N	ALTA	122,951	111,686,154.63	4.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					**2,699,958,279.67**	**99.93**
OTROS VALORES				217,741	**1,865,294.91**	**0.07**
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					**2,701,823,574.58**	**100.00**

CATEGORÍA
RVESPTKINT

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.149%	2.790%

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