GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, 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	VAGU	N	ALTA	616,000	293,480,313.28	28.38
1ISP	VNRA	N	ALTA	52,050	183,120,335.43	17.71
1ISP	VWCG	N	ALTA	93,550	113,632,204.87	10.99
1ISP	VDEA	N	ALTA	81,000	90,303,832.37	8.73
1ISP	VFEA	N	ALTA	46,600	73,732,887.65	7.13
1ISP	VDPA	N	ALTA	65,500	70,293,675.40	6.80
1ISP	VITS	N	ALTA	28,606	50,697,842.14	4.90
1ISP	VJPA	N	ALTA	48,769	44,300,754.57	4.28
1ISP	VUDS	N	ALTA	22,630	41,403,760.92	4.00
1ISP	VLDS	N	ALTA	23,065	39,873,630.05	3.86
1ISP	VAPU	N	ALTA	30,695	32,444,724.52	3.14
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					**1,033,283,961.20**	**99.93**
OTROS VALORES				73,508	**679,142.45**	**0.07**
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					**1,033,963,103.65**	**100.00**

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.661%	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