

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 16 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	608,496	285,919,754.25	28.99
1ISP	VNRA	N	ALTA	50,995	169,374,143.94	17.17
1ISP	VWCG	N	ALTA	91,003	108,367,665.10	10.99
1ISP	VDEA	N	ALTA	79,336	88,040,222.22	8.93
1ISP	VFEA	N	ALTA	45,666	68,907,500.77	6.99
1ISP	VDPA	N	ALTA	64,143	68,583,233.30	6.95
1ISP	VITS	N	ALTA	28,051	49,030,125.42	4.97
1ISP	VJPA	N	ALTA	47,770	39,582,441.17	4.01
1ISP	VUDS	N	ALTA	22,346	39,528,502.52	4.01
1ISP	VLDS	N	ALTA	22,625	39,231,703.91	3.98
1ISP	VAPU	N	ALTA	30,037	28,902,611.51	2.93
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					985,467,904.11	99.90
OTROS VALORES				104,847	968,735.92	0.10
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					986,436,640.03	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.677%

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