

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	559,224	262,980,731.93	28.97
1ISP	VNRA	N	ALTA	49,692	156,233,368.54	17.21
1ISP	VWCG	N	ALTA	85,438	98,385,556.12	10.84
1ISP	VDEA	N	ALTA	73,706	81,431,439.55	8.97
1ISP	VDPA	N	ALTA	59,214	63,300,990.84	6.97
1ISP	VFEA	N	ALTA	41,811	62,601,555.21	6.90
1ISP	VITS	N	ALTA	25,800	45,319,639.75	4.99
1ISP	VUDS	N	ALTA	20,586	36,399,100.16	4.01
1ISP	VLDS	N	ALTA	20,703	36,157,519.37	3.98
1ISP	VJPA	N	ALTA	44,862	35,661,599.83	3.93
1ISP	VAPU	N	ALTA	29,204	27,211,872.27	3.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					905,683,373.57	99.79
OTROS VALORES				207,690	1,932,122.80	0.21
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					907,615,496.37	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.760%

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