

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 MARZO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	457,620	219,961,568.59	25.58
1ISP	VNRA	N	ALTA	56,416	163,663,626.59	19.03
1ISP	VWCG	N	ALTA	114,072	125,323,549.67	14.57
1ISP	VDPA	N	ALTA	104,578	113,779,602.68	13.23
1ISP	VDEA	N	ALTA	69,827	77,152,503.65	8.97
1ISP	VFEA	N	ALTA	35,817	49,943,271.65	5.81
1ISP	VDTA	N	ALTA	90,156	43,914,932.15	5.11
1ISP	VAPU	N	ALTA	45,637	36,616,023.29	4.26
1ISP	VJPA	N	ALTA	34,075	25,888,808.44	3.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					856,243,886.71	99.57
OTROS VALORES				397,307	3,665,851.28	0.43
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					859,909,737.99	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.809%	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