

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 14 MAYO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	564,766	261,635,535.40	28.08
1ISP	VNRA	N	ALTA	50,434	163,471,458.61	17.55
1ISP	VWCG	N	ALTA	86,712	99,417,914.13	10.67
1ISP	VDEA	N	ALTA	74,805	81,667,962.06	8.77
1ISP	VFEA	N	ALTA	43,098	65,347,130.50	7.01
1ISP	VDPA	N	ALTA	59,879	63,308,346.32	6.80
1ISP	VITS	N	ALTA	26,089	45,092,465.87	4.84
1ISP	VJPA	N	ALTA	45,373	37,067,767.37	3.98
1ISP	VUDS	N	ALTA	20,817	36,287,824.44	3.90
1ISP	VLDS	N	ALTA	20,703	35,563,008.48	3.82
1ISP	VAPU	N	ALTA	29,769	30,438,437.38	3.27
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					919,297,850.56	98.68
OTROS VALORES				1,186,693	12,338,147.47	1.32
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					931,635,998.03	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.710%

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