

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 04 JUNIO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	579,734	270,908,157.85	28.29
1ISP	VNRA	N	ALTA	51,515	169,658,627.82	17.72
1ISP	VWCG	N	ALTA	88,571	102,990,146.76	10.75
1ISP	VDEA	N	ALTA	75,899	83,741,381.21	8.74
1ISP	VFEA	N	ALTA	44,022	67,148,036.01	7.01
1ISP	VDPA	N	ALTA	61,385	65,365,401.73	6.83
1ISP	VITS	N	ALTA	26,746	46,385,560.31	4.84
1ISP	VJPA	N	ALTA	47,236	39,165,128.37	4.09
1ISP	VJDS	N	ALTA	21,080	36,916,166.81	3.86
1ISP	VLDS	N	ALTA	21,158	36,494,032.21	3.81
1ISP	VAPU	N	ALTA	30,542	32,398,886.90	3.38
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					951,171,525.98	99.33
OTROS VALORES				681,292	6,448,088.10	0.67
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					957,619,614.08	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.688%

Límite 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