

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 23 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	548,507	257,831,096.20	28.93
1ISP	VNRA	N	ALTA	48,886	152,820,939.62	17.14
1ISP	VWCG	N	ALTA	84,123	96,699,355.44	10.85
1ISP	VDEA	N	ALTA	72,580	80,364,771.49	9.02
1ISP	VFEA	N	ALTA	41,811	62,169,254.55	6.97
1ISP	VDPA	N	ALTA	57,578	61,851,058.68	6.94
1ISP	VITS	N	ALTA	25,000	43,946,716.50	4.93
1ISP	VUDS	N	ALTA	20,250	35,730,000.01	4.01
1ISP	VLDS	N	ALTA	20,350	35,658,306.53	4.00
1ISP	VJPA	N	ALTA	44,862	35,025,245.01	3.93
1ISP	VAPU	N	ALTA	29,204	26,860,058.92	3.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					888,956,802.95	99.73
OTROS VALORES				255,024	2,420,696.47	0.27
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					891,377,499.42	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.789%

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