

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 29 MAYO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	348,419	175,513,662.28	23.83
1ISP	VNRA	N	ALTA	54,251	154,751,869.17	21.01
1ISP	VWCG	N	ALTA	105,666	114,649,960.65	15.57
1ISP	VDPA	N	ALTA	81,926	91,652,335.66	12.44
1ISP	VDEA	N	ALTA	57,160	63,896,418.38	8.68
1ISP	VFEA	N	ALTA	34,668	45,455,332.39	6.17
1ISP	VDTA	N	ALTA	68,574	34,656,241.64	4.71
1ISP	VAPU	N	ALTA	48,504	30,592,290.38	4.15
1ISP	VJPA	N	ALTA	32,742	22,756,491.66	3.09
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					733,924,602.21	99.65
OTROS VALORES				24,813	2,585,009.97	0.35
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					736,509,612.18	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.375%

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