

GBMfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 26 MARZO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	455,750	218,525,564.02	25.38
1ISP	VNRA	N	ALTA	56,416	165,960,685.72	19.28
1ISP	VWCG	N	ALTA	114,072	125,326,381.28	14.56
1ISP	VDPA	N	ALTA	103,584	112,626,352.75	13.08
1ISP	VDEA	N	ALTA	69,827	77,612,576.78	9.02
1ISP	VFEA	N	ALTA	35,817	50,244,672.74	5.84
1ISP	VDTA	N	ALTA	90,156	43,752,976.55	5.08
1ISP	VAPU	N	ALTA	45,637	37,557,555.17	4.36
1ISP	VJPA	N	ALTA	34,075	26,234,550.77	3.05
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					857,841,315.78	99.64
OTROS VALORES				345,292	3,090,355.61	0.36
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					860,931,671.39	100.00

CATEGORÍA		
RVDIS		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.812%	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