

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 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	591,281	281,375,507.07	28.61
1ISP	VNRA	N	ALTA	52,062	171,379,598.74	17.42
1ISP	VWCG	N	ALTA	89,187	106,326,923.59	10.81
1ISP	VDEA	N	ALTA	77,433	86,704,472.31	8.82
1ISP	VFEA	N	ALTA	44,732	68,333,845.85	6.95
1ISP	VDPA	N	ALTA	62,155	67,320,754.51	6.84
1ISP	VITS	N	ALTA	27,118	47,738,606.00	4.85
1ISP	VJPA	N	ALTA	48,226	40,333,602.28	4.10
1ISP	VUDS	N	ALTA	21,668	38,442,998.41	3.91
1ISP	VLDS	N	ALTA	21,744	38,198,297.98	3.88
1ISP	VAPU	N	ALTA	30,904	32,944,118.66	3.35
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					979,098,725.40	99.55
OTROS VALORES				473,516	4,461,094.39	0.45
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					983,559,819.79	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.676%

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