

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 OCTUBRE, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	405,542	202,600,512.58	24.95
1ISP	VNRA	N	ALTA	51,377	163,692,605.36	20.16
1ISP	VWCG	N	ALTA	107,450	120,313,764.86	14.82
1ISP	VDPA	N	ALTA	92,829	105,061,499.89	12.94
1ISP	VDEA	N	ALTA	63,682	73,585,536.80	9.06
1ISP	VFEA	N	ALTA	32,790	48,581,083.22	5.98
1ISP	VDTA	N	ALTA	80,478	40,503,702.28	4.99
1ISP	VAPU	N	ALTA	44,742	33,447,375.07	4.12
1ISP	VJPA	N	ALTA	31,611	24,015,183.20	2.96
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					811,801,263.26	99.98
OTROS VALORES				21,173	191,429.91	0.02
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					811,992,693.17	100.00

CATEGORÍA		
RVDIS		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.008%	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