

gbmfondos

GMP+ GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 04 DICIEMBRE, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VAGU	N	ALTA	415,933	203,840,129.78	24.99
1ISP	VNRA	N	ALTA	52,690	164,966,571.65	20.22
1ISP	VWCG	N	ALTA	109,556	122,628,363.58	15.03
1ISP	VDPA	N	ALTA	94,162	104,933,830.54	12.86
1ISP	VDEA	N	ALTA	64,574	73,786,584.35	9.05
1ISP	VFEA	N	ALTA	32,790	46,743,863.98	5.73
1ISP	VDTA	N	ALTA	80,478	39,866,268.07	4.89
1ISP	VAPU	N	ALTA	44,742	32,197,050.08	3.95
1ISP	VJPA	N	ALTA	31,611	23,742,323.56	2.91
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					812,704,985.59	99.63
OTROS VALORES				324,110	3,045,135.17	0.37
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					815,750,120.76	100.00

CATEGORÍA		
RVDIS		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.976%	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