

**GBMAAA GBM INS-
CARTERA**

Tipo Valor	Emisora	Serie
-------------------	----------------	--------------

DIRECTO

ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRA)

1ASP	TSM	N
1ASP	AMZN	*
1ASP	MSFT	*
1ASP	AVGO	*
1ASP	GOOGL	*
1ASP	AMAT	*
1ASP	MITS	N
1ASP	HEXAB	N
1ASP	ELU	N
1ASP	ADI	*
1ASP	FANU	N
1ASP	TEL1	N
1ASP	MRVL1	*
1ASP	NVDA	*
1ASP	AAPL	*
1ASP	SIE	N
1ASP	TMO	*
1ASP	KEYS	*

OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES

TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO

OTROS VALORES

TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES

CALIFICACIÓN

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de
siguiendo los criterios metodológicos ap
El método utilizado para la estimación del VaR es el

- El n
 - El horizonte tempor:
-

GBMfondos

INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V. VALORES AL 10 DICIEMBRE, 2025

Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable
IE)		
ALTA	2,569	14,486,821.02
ALTA	2,776	11,698,943.08
ALTA	1,337	11,633,730.81
ALTA	1,492	11,203,108.31
ALTA	1,851	10,776,866.85
ALTA	1,996	9,985,763.17
ALTA	14,604	7,878,399.14
ALTA	35,665	7,605,242.73
ALTA	1,209	7,315,348.91
ALTA	1,423	7,285,216.94
ALTA	10,180	7,260,011.56
ALTA	1,616	7,173,212.81
ALTA	4,238	7,125,461.83
ALTA	2,102	7,023,962.21
ALTA	1,375	6,969,723.02
ALTA	1,413	6,947,756.69
ALTA	656	6,844,207.37
ALTA	1,738	6,724,063.16
ONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)	91,772	166,176,390.66
		322,114,230.27
	351,614	7,601,632.58
		329,715,862.85

CATEGORÍA

RVDIS

VaR Promedio

Límite de VaR

1.507%

5.080%

Inversión administrados por Operadora GBM, se acordó con la empresa Valor de Mercado (Valmer) que se robarados por la Unidad de Administración Integral de riesgos de la Operadora.

conocido como simulación histórica, con los parámetros que se presentan a continuación:

- Un periodo de muestra de un año

ivel de confianza para el VaR fijado al 95%

al para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día

Lic. Julio Andres Maza Casas

Participación Porcentual

4.39
3.55
3.53
3.40
3.27
3.03
2.39
2.31
2.22
2.21
2.20
2.18
2.16
2.13
2.11
2.11
2.08
2.04
50.40
97.69

2.31

100.00

ue sea ella quien lo realice,