

GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 15 MAYO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ASP	MSFT	*	ALTA	755	6,672,164.34	4.00
1ASP	GOOGL	*	ALTA	1,980	6,331,404.59	3.80
1ASP	AMZN	*	ALTA	1,399	5,597,943.88	3.36
1ASP	TSM	N	ALTA	1,400	5,302,967.34	3.18
1ASP	AAPL	*	ALTA	933	3,847,567.97	2.31
1ASP	AVGO	*	ALTA	830	3,765,819.06	2.26
1ASP	CRM	*	ALTA	636	3,606,523.31	2.16
1ASP	HEXAB	N	ALTA	17,952	3,552,682.29	2.13
1ASP	WKL	N	ALTA	1,012	3,512,078.71	2.11
1ASP	MMC	*	ALTA	786	3,483,407.59	2.09
1ASP	SAP	N	ALTA	596	3,421,426.91	2.05
1ASP	AMAT	*	ALTA	1,000	3,408,114.30	2.05
1ASP	EXPN	N	ALTA	3,320	3,384,182.20	2.03
1ASP	V	*	ALTA	478	3,377,483.20	2.03
1ASP	SIE	N	ALTA	695	3,363,239.43	2.02
1ASP	MA	*	ALTA	295	3,349,586.40	2.01
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				54,102	94,533,800.63	56.73
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					160,510,392.15	96.32
REPORTO						
LF	BONDEF	270225	mxAAA	43,592	4,367,673.43	2.62
TOTAL REPORTO					4,367,673.43	2.62
OTROS VALORES				132,263	1,763,399.18	1.06
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					166,641,464.76	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.708%

Limite de VaR
3.220%

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