

# GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 04 JUNIO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ASP	TSM	N	ALTA	2,862	22,013,993.00	6.18
1ASP	AMAT	*	ALTA	1,720	14,918,316.40	4.19
1ASP	AMZN	*	ALTA	3,081	13,518,032.00	3.80
1ASP	GOOGL	*	ALTA	2,075	13,351,500.22	3.75
1ASP	MSFT	*	ALTA	1,560	11,544,267.08	3.24
1ASP	NVDA	*	ALTA	2,904	10,977,747.11	3.08
1ASP	MITC	N	ALTA	16,641	10,701,261.04	3.00
1ASP	FANU	N	ALTA	11,600	9,775,640.16	2.74
1ASP	KEYS	*	ALTA	1,561	9,259,414.91	2.60
1ASP	AVGO	*	ALTA	1,239	8,973,033.73	2.52
1ASP	SIE	N	ALTA	1,580	8,629,364.80	2.42
1ASP	AAPL	*	ALTA	1,549	8,334,511.24	2.34
1ASP	KEY	N	ALTA	944	8,163,411.51	2.29
1ASP	AMD	*	ALTA	827	7,480,325.75	2.10
1ASP	QCOM	*	ALTA	1,748	7,330,368.08	2.06
1ASP	SU	N	ALTA	1,282	7,254,025.47	2.04
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				183,135	167,429,643.21	47.01
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ISP	BIL	*	ALTA	5,220	8,249,193.25	2.32
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>347,904,048.96</b>	<b>97.68</b>
<b>OTROS VALORES</b>				251,096	<b>8,279,000.03</b>	<b>2.32</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>356,183,048.99</b>	<b>100.00</b>

## CATEGORÍA

RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
1.226%

Límite de VaR  
5.080%

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