

gbmfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0011841		128,439	128,439.00	0.01
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,634,225.63	0.16
					1,762,664.63	0.17
TOTAL DISPONIBILIDADES						
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	SHW	*	NA	2,000	22,020,012.00	2.14
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	NA	7,500	16,742,396.25	1.63
1ASP	AUE	*	NA	3,300	5,818,285.69	0.57
1ASP	AOS	*	NA	4,000	3,822,876.00	0.37
1ASP	CPRT	*	NA	9,000	14,308,083.00	1.39
1ASP	IEX	*	NA	1,750	5,236,014.66	0.51
1ASP	ROP	*	NA	2,250	14,585,103.00	1.42
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	BKNG	*	NA	772	30,427,000.34	2.96
1ASP	BURL	*	NA	3,250	12,014,828.72	1.17
1ASP	DPZ	*	NA	1,100	5,747,818.73	0.56
1ASP	HD	*	ALTA	8,250	37,230,045.19	3.62
1ASP	NKE	*	NA	14,000	24,118,053.75	2.34
1ASP	TJX	*	ALTA	12,500	13,863,023.44	1.35
1ASP	ULTA	*	NA	2,650	11,885,841.28	1.16
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	COST	*	ALTA	4,100	23,434,179.86	2.28
1ASP	MNST	*	NA	28,750	31,044,275.16	3.02
1ASP	STZ	*	ALTA	1,400	5,126,062.73	0.50
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ABMD	*	NA	1,750	6,988,310.44	0.68
1ASP	ALGN	*	NA	1,600	7,765,486.20	0.75
1ASP	EW	*	NA	5,500	25,222,093.88	2.45
1ASP	ILMN	*	NA	1,250	7,108,332.50	0.69
1ASP	ISRG	*	NA	3,100	32,975,864.44	3.21
1ASP	MTD	*	NA	380	5,153,287.64	0.50
1ASP	REGN	*	NA	3,750	22,095,230.63	2.15
1ASP	SYK	*	NA	4,250	17,682,100.03	1.72
1ASP	UNH	*	NA	10,500	51,043,820.63	4.96
1ASP	VRTX	*	NA	9,800	36,853,355.70	3.58
1ASP	ZTS	*	NA	16,500	40,604,206.50	3.95
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	V	*	ALTA	14,700	50,580,042.98	4.92
1ASP	VEEV	*	NA	1,200	3,274,145.55	0.32
1ISP	BIL	*	ALTA	57,261	100,902,757.46	9.81
1ISP	SPY	*	ALTA	1,801	10,509,394.89	1.02
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	AAPL	*	ALTA	843	4,034,193.78	0.39
1ASP	ADBE	*	NA	2,350	12,564,694.18	1.22
1ASP	ANET	*	NA	3,000	14,114,746.13	1.37
1ASP	ANSS	*	NA	1,000	4,235,135.63	0.41
1ASP	APH	*	NA	2,550	4,921,750.86	0.48
1ASP	CGNX	*	NA	4,600	4,556,478.83	0.44
1ASP	EA	*	NA	10,400	19,286,748.00	1.87
1ASP	FB	*	NA	14,150	52,169,166.26	5.07
1ASP	GOOG	*	ALTA	3,045	73,814,959.85	7.17
1ASP	IPGP	*	NA	2,000	5,166,423.00	0.50
1ASP	MSFT	*	ALTA	23,750	65,504,408.91	6.37
1ASP	PAYC	*	NA	900	3,662,377.54	0.36
1ASP	PYPL	*	NA	13,325	26,684,961.47	2.59
1ASP	TXN	*	ALTA	1,500	3,404,748.94	0.33
1ASP	TYL	*	NA	730	3,770,927.06	0.37
1ASP	XLNX	*	NA	7,500	13,092,080.63	1.27
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	SPGI	*	NA	800	3,970,466.10	0.39
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,011,134,596.46	98.28
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,011,134,596.46	98.28
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
M	BONOS	231207	mxAAA	9,840	1,065,136.76	0.10
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,065,136.76	0.10
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ASP	AAPL	*	ALTA	1,030	4,929,086.12	0.48
1ASP	AAPL	*	ALTA	127	607,761.10	0.06
1ASP	COST	*	ALTA	400	2,286,251.45	0.22
1ASP	FB	*	NA	900	3,318,180.19	0.32
1ASP	GOOG	*	ALTA	105	2,545,343.44	0.25
1ISP	BIL	*	ALTA	39	68,724.05	0.01
1ISP	SPY	*	ALTA	24	140,047.46	0.01
1ISP	SPY	*	ALTA	75	437,648.32	0.04
1ISP	SPY	*	ALTA	31	180,894.64	0.02
1ISP	SPY	*	ALTA	69	402,636.45	0.04
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					14,916,583.22	1.45
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,028,876,981.07	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.835%

Límite de VaR
2.310%

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