

gbmfondos

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

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,600,141.73	0.16
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,600,141.73	0.16
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	SHW	*	NA	1,800	19,859,908.59	2.03
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	NA	6,500	15,305,810.33	1.56
1ASP	AME	*	NA	3,000	5,657,502.15	0.58
1ASP	AOS	*	NA	4,000	3,603,013.20	0.37
1ASP	CPRT	*	NA	6,600	11,348,357.13	1.16
1ASP	IEX	*	NA	1,750	5,691,157.50	0.58
1ASP	ROP	*	NA	2,200	14,734,728.20	1.51
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	BKNG	*	NA	530	20,580,376.99	2.10
1ASP	BURL	*	NA	3,450	14,874,596.43	1.52
1ASP	DPZ	*	NA	620	3,443,880.12	0.35
1ASP	FIVE	*	NA	1,355	3,275,730.05	0.33
1ASP	HD	*	ALTA	6,930	28,614,107.56	2.93
1ASP	NKE	*	NA	13,750	26,338,383.84	2.69
1ASP	TJX	*	ALTA	10,500	12,122,165.48	1.24
1ASP	ULTA	*	NA	2,350	11,247,674.69	1.15
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	COST	*	ALTA	3,770	20,950,992.35	2.14
1ASP	MNST	*	NA	25,000	30,039,290.63	3.07
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ABMD	*	NA	1,500	4,838,145.64	0.49
1ASP	ALGN	*	NA	1,415	7,465,467.55	0.76
1ASP	EW	*	NA	4,180	18,437,690.22	1.89
1ASP	ILMN	*	NA	2,900	18,189,884.75	1.86
1ASP	ISRG	*	NA	2,735	30,569,556.19	3.13
1ASP	MTD	*	NA	245	3,674,740.69	0.38
1ASP	REGN	*	NA	2,480	17,606,482.49	1.80
1ASP	SYK	*	NA	3,200	12,702,209.76	1.30
1ASP	UNH	*	NA	9,600	53,360,897.76	5.46
1ASP	VRTX	*	NA	8,700	36,016,234.99	3.68
1ASP	ZTS	*	NA	14,500	36,284,910.56	3.71
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	V	*	ALTA	13,350	47,428,801.99	4.85
1ASP	VEEV	*	NA	1,000	2,659,528.95	0.27
1ISP	BIL	*	ALTA	53,992	93,336,657.45	9.54
1ISP	SPY	*	ALTA	1,500	9,128,351.93	0.93
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	AAPL	*	ALTA	720	3,997,574.91	0.41
1ASP	ADBE	*	NA	2,050	12,783,559.28	1.31
1ASP	ANET	*	NA	2,600	9,999,042.30	1.02
1ASP	ANSS	*	NA	1,000	4,866,979.58	0.50
1ASP	APH	*	NA	2,180	4,461,062.02	0.46
1ASP	CGNX	*	NA	3,380	3,581,367.89	0.37
1ASP	EA	*	NA	8,520	17,318,990.17	1.77
1ASP	EEFT	*	NA	675	2,010,869.35	0.21
1ASP	FB	*	NA	12,150	47,151,287.16	4.82
1ASP	GOOG	*	ALTA	2,795	70,656,777.29	7.22
1ASP	IPGP	*	NA	1,400	3,836,104.86	0.39
1ASP	MSFT	*	ALTA	21,400	63,808,652.85	6.52
1ASP	PAYC	*	NA	760	3,804,521.77	0.39
1ASP	PYPL	*	NA	11,950	24,440,430.09	2.50
1ASP	QCOM	*	ALTA	3,250	5,421,678.36	0.55
1ASP	TXN	*	ALTA	1,225	2,971,412.89	0.30
1ASP	TYL	*	NA	730	4,141,018.55	0.42
1ASP	XLNX	*	NA	6,600	12,200,669.42	1.25
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	SPGI	*	NA	800	4,130,154.30	0.42
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					940,969,389.20	96.20
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
EAIM	GBM-INT	0011841		133,363	133,363.00	0.01
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					133,363.00	0.01
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					941,102,752.20	96.22
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
M	BONOS	231207	mxAAA	191,085	20,130,220.18	2.06
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					20,130,220.18	2.06
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ASP	AAPL	*	ALTA	1,030	5,718,753.00	0.58
1ASP	COST	*	ALTA	400	2,222,916.96	0.23
1ASP	FB	*	NA	300	1,164,229.31	0.12
1ASP	FB	*	NA	900	3,492,687.94	0.36
1ASP	GOOG	*	ALTA	105	2,654,369.09	0.27
1ISP	BIL	*	ALTA	8	13,829.70	0.00
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					15,266,786.00	1.56
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					978,099,900.11	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.407%

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

Lic. Raymundo Leal Vargas