GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 MARZO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0011841		158,208	158,208.00	0.01
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,762,906.88	0.08
TOTAL DISPONIBILIDADES					**1,921,114.88**	**0.09**
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	SHW	*	NA	2,373	35,795,649.95	1.59
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	NA	6,289	16,147,699.23	0.72
1ASP	AME	*	NA	5,004	13,064,129.62	0.58
1ASP	CPRT	*	NA	11,596	25,742,355.77	1.15
1ASP	IEX	*	NA	1,771	7,577,039.56	0.34
1ASP	ROP	*	NA	3,513	28,961,410.64	1.29
1ASP	TREX1	*	NA	4,635	8,672,232.53	0.39
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	AMZN	*	ALTA	2,037	128,822,829.90	5.74
1ASP	BURL	*	NA	1,489	9,093,803.35	0.41
1ASP	CHGG	*	NA	3,980	6,968,373.33	0.31
1ASP	DPZ	*	NA	1,867	14,035,067.40	0.63
1ASP	ETSY	*	NA	2,688	11,080,027.30	0.49
1ASP	HD	*	ALTA	10,722	66,896,245.37	2.98
1ASP	NKE	*	NA	21,438	58,230,006.11	2.59
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	COST	*	ALTA	7,159	51,577,122.60	2.30
1ASP	MNST	*	NA	38,666	71,989,675.57	3.21
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ABMD	*	NA	1,150	7,491,884.11	0.33
1ASP	ALGN	*	NA	3,035	33,593,208.39	1.50
1ASP	EW	*	NA	27,068	46,274,364.13	2.06
1ASP	ILMN	*	NA	1,575	12,363,741.13	0.55
1ASP	ISRG	*	NA	4,377	66,108,300.20	2.94
1ASP	REGN	*	NA	3,547	34,302,132.62	1.53
1ASP	UNH	*	NA	12,047	91,616,528.64	4.08
1ASP	VEEV	*	NA	3,184	17,001,334.10	0.76
1ASP	VRTX	*	NA	13,368	58,715,519.86	2.62
1ASP	ZTS	*	NA	25,036	80,586,188.75	3.59
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	MKTX	*	NA	797	8,111,256.96	0.36
1ASP	V	*	ALTA	22,512	97,424,176.90	4.34
1ISP	BIL	*	ALTA	74,209	138,786,729.28	6.18
1ISP	IWF	*	NA	6,239	30,992,956.72	1.38
1ISP	SPY	*	ALTA	21	170,116.53	0.01
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	ADBE	*	NA	5,477	53,216,312.65	2.37
1ASP	ANET	*	NA	3,162	19,511,059.83	0.87
1ASP	APH	*	NA	10,393	14,013,856.92	0.62
1ASP	ASML	N	NA	2,794	34,704,945.59	1.55
1ASP	CGNX	*	NA	5,092	8,637,427.74	0.38
1ASP	EA	*	NA	11,922	32,986,923.56	1.47
1ASP	EPAM	*	NA	1,828	14,821,689.53	0.66
1ASP	FB	*	NA	19,349	116,481,868.80	5.19
1ASP	FTNT	*	NA	8,063	30,393,096.23	1.35
1ASP	GOOG	*	ALTA	3,978	168,196,852.76	7.49
1ASP	IPGP	*	NA	4,446	19,168,965.15	0.85
1ASP	MSFT	*	ALTA	33,816	162,960,011.26	7.26
1ASP	NVDA	*	NA	2,486	27,130,369.92	1.21
1ASP	PYPL	*	NA	10,172	50,489,008.65	2.25
1ASP	QCOM	*	ALTA	20,615	55,868,161.18	2.49
1ASP	TXN	*	ALTA	1,945	7,513,264.85	0.33
1ASP	TYL	*	NA	1,338	11,610,068.09	0.52
1ASP	XLNX	*	NA	16,465	41,696,855.93	1.86
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	SPGI	*	NA	970	6,996,111.77	0.31
1ASP	TTWO	*	NA	5,658	20,434,770.30	0.91
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					**2,175,023,727.26**	**96.87**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**2,175,023,727.26**	**96.87**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	240627	mxAAA	53,470	5,341,300.97	0.24
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**5,341,300.97**	**0.24**
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ASP	DPZ	*	NA	100	751,744.37	0.03
1ASP	GOOG	*	ALTA	150	6,342,264.43	0.28
1ASP	ILMN	*	NA	100	784,999.44	0.04
1ASP	NVDA	*	NA	32	349,224.39	0.02
1ASP	PYPL	*	NA	1,000	4,963,528.18	0.22
1ASP	QCOM	*	ALTA	1,000	2,710,073.31	0.12
1ASP	UNH	*	NA	884	6,722,753.49	0.30
1ASP	UNH	*	NA	1,000	7,604,924.77	0.34
1ASP	UNH	*	NA	1,000	7,604,924.77	0.34
1ISP	IWF	*	NA	100	496,761.61	0.02
1ISP	SPY	*	ALTA	1,300	10,531,023.15	0.47
1ISP	SPY	*	ALTA	1,500	12,151,180.55	0.54
1ISP	SPY	*	ALTA	240	1,944,188.89	0.09
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					**62,957,591.35**	**2.80**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**2,245,243,734.46**	**100.00**

CATEGORÍA	CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES		2.185%	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

Ing. Fernando Castro Tapia