

GBMfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 23 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBMINT	0011841		155,208	155,208.00	0.01
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,725,140.84	0.06
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,880,348.84	0.06
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	SHW	*	NA	5,842	34,430,880.75	1.16
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	NA	7,205	20,004,605.33	0.67
1ASP	AME	*	NA	5,302	13,724,823.90	0.46
1ASP	CPRT	*	NA	12,849	37,535,816.79	1.26
1ASP	IEX	*	NA	3,465	15,076,243.71	0.51
1ASP	ROP	*	NA	4,777	44,274,432.81	1.49
1ASP	TREX1	*	NA	5,434	11,707,951.39	0.39
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	AMZN	*	ALTA	2,307	157,846,721.00	5.31
1ASP	CHGG	*	NA	17,693	26,135,668.33	0.88
1ASP	DPZ	*	NA	2,075	20,481,781.13	0.69
1ASP	ETSY	*	NA	6,112	27,380,525.19	0.92
1ASP	HD	*	ALTA	13,772	92,659,521.90	3.12
1ASP	NKE	*	NA	28,975	92,613,013.00	3.11
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	COST	*	ALTA	8,540	77,448,892.87	2.60
1ASP	MNST	*	NA	36,155	67,412,666.23	2.27
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ABMD	*	NA	2,546	17,879,394.47	0.60
1ASP	ALGN	*	NA	3,443	50,142,646.07	1.69
1ASP	EW	*	NA	25,021	60,650,155.62	2.04
1ASP	ILMN	*	NA	1,762	15,288,485.30	0.51
1ASP	ISRG	*	NA	3,938	82,412,978.51	2.77
1ASP	UNH	*	NA	13,963	114,114,528.83	3.84
1ASP	VEEV	*	NA	2,828	16,919,391.35	0.57
1ASP	VRTX	*	NA	15,163	56,213,185.73	1.89
1ASP	ZTS	*	NA	26,157	107,249,950.08	3.61
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	MKTX	*	NA	797	6,786,088.74	0.23
1ASP	V	*	ALTA	32,944	150,650,775.42	5.07
1ISP	BIL	*	ALTA	124,184	227,492,429.92	7.65
1ISP	IWF	*	NA	12,342	71,001,958.44	2.39
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	ADBE	*	NA	6,194	78,263,728.18	2.63
1ASP	ANET	*	NA	3,515	25,198,185.58	0.85
1ASP	APH	*	NA	15,349	23,684,622.57	0.80
1ASP	ASML	N	NA	2,309	40,853,935.69	1.38
1ASP	CGNX	*	NA	5,549	9,887,343.15	0.33
1ASP	EA	*	NA	7,140	18,289,629.47	0.62
1ASP	EPAM	*	NA	2,140	26,983,626.23	0.91
1ASP	FB	*	NA	21,757	150,763,082.43	5.07
1ASP	FTNT	*	NA	6,645	41,331,640.38	1.39
1ASP	GOOG	*	ALTA	4,515	256,516,463.52	8.63
1ASP	IPGP	*	NA	5,621	18,309,831.83	0.62
1ASP	MSFT	*	ALTA	41,194	247,165,525.00	8.31
1ASP	NVDA	*	NA	13,141	59,174,346.01	1.99
1ASP	PTC	*	NA	4,572	11,340,632.40	0.38
1ASP	PYPL	*	NA	12,470	69,710,211.12	2.34
1ASP	QCOM	*	ALTA	29,720	79,713,508.25	2.68
1ASP	TXN	*	ALTA	2,152	8,563,369.17	0.29
1ASP	TYL	*	NA	1,426	13,779,197.98	0.46
1ASP	XLNK	*	NA	14,567	45,574,431.28	1.53
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	TTWO	*	NA	7,185	21,109,005.93	0.71
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					2,961,847,828.98	99.61
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,961,847,828.98	99.61
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	220127	mxAAA	543,696	5,338,503.88	0.18
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					5,338,503.88	0.18
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ASP	NVDA	*	NA	971	4,372,444.26	0.15
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					4,372,444.26	0.15
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,973,439,125.96	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.527%

Límite de VaR
2.310%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para los 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