

gbmfondos

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

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0011841		155,559	155,559.00	0.01
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,731,684.38	0.06
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,887,243.38	0.06
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	SHW	*	NA	6,581	40,123,925.45	1.33
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	NA	6,574	19,005,165.95	0.63
1ASP	AME	*	NA	5,302	14,474,129.55	0.48
1ASP	CPRT	*	NA	12,849	37,231,067.10	1.23
1ASP	IEX	*	NA	3,465	15,583,352.40	0.51
1ASP	ROP	*	NA	4,587	44,507,909.62	1.47
1ASP	TREX1	*	NA	5,434	11,974,940.58	0.40
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	AMZN	*	ALTA	2,280	158,881,312.59	5.25
1ASP	CHGG	*	NA	12,345	20,626,637.69	0.68
1ASP	DPZ	*	NA	2,075	21,534,057.37	0.71
1ASP	ETSY	*	NA	6,012	26,103,864.42	0.86
1ASP	HD	*	ALTA	13,493	88,364,023.67	2.92
1ASP	NKE	*	NA	28,359	93,799,302.48	3.10
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	COST	*	ALTA	8,440	77,184,648.01	2.55
1ASP	MNST	*	NA	36,155	70,826,259.36	2.34
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ABMD	*	NA	2,546	18,604,657.97	0.61
1ASP	ALGN	*	NA	3,443	49,010,924.24	1.62
1ASP	EW	*	NA	25,021	58,866,442.56	1.94
1ASP	ILMN	*	NA	1,762	16,172,745.88	0.53
1ASP	ISRG	*	NA	4,368	92,395,652.73	3.05
1ASP	UNH	*	NA	13,719	114,658,750.23	3.79
1ASP	VEEV	*	NA	2,828	18,849,548.86	0.62
1ASP	VRTX	*	NA	15,163	60,975,312.69	2.01
1ASP	ZTS	*	NA	26,157	107,428,195.78	3.55
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	MKTX	*	NA	797	7,615,561.19	0.25
1ASP	V	*	ALTA	29,893	137,500,483.69	4.54
1ISP	BIL	*	ALTA	132,460	243,208,133.69	8.03
1ISP	IWF	*	NA	13,770	80,424,301.21	2.66
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	ADBE	*	NA	6,194	82,537,755.23	2.73
1ASP	ANET	*	NA	3,515	26,078,623.59	0.86
1ASP	APH	*	NA	15,349	23,615,032.42	0.78
1ASP	ASML	N	NA	2,518	42,043,025.06	1.39
1ASP	CGNX	*	NA	5,549	9,873,158.41	0.33
1ASP	EA	*	NA	8,216	23,953,368.22	0.79
1ASP	EPAM	*	NA	1,994	25,334,254.09	0.84
1ASP	FB	*	NA	21,757	165,723,111.43	5.47
1ASP	FTNT	*	NA	6,645	42,044,399.16	1.39
1ASP	GOOG	*	ALTA	4,483	261,853,222.93	8.65
1ASP	IPGP	*	NA	5,621	19,262,198.50	0.64
1ASP	MSFT	*	ALTA	40,869	247,706,833.26	8.18
1ASP	NVDA	*	NA	12,958	58,237,766.24	1.92
1ASP	PYPL	*	NA	12,470	72,270,772.24	2.39
1ASP	QCOM	*	ALTA	26,195	77,148,688.20	2.55
1ASP	TXN	*	ALTA	2,152	8,248,606.37	0.27
1ASP	TYL	*	NA	1,426	13,905,841.14	0.46
1ASP	XLNX	*	NA	14,567	45,505,242.76	1.50
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	TTWO	*	NA	7,185	23,257,087.34	0.77
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					3,014,530,293.55	99.55
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,014,530,293.55	99.55
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	220113	mxAAA	537,512	5,273,573.69	0.17
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					5,273,573.69	0.17
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ASP	COST	*	ALTA	100	914,510.05	0.03
1ASP	ETSY	*	NA	100	434,196.02	0.01
1ASP	NVDA	*	NA	1,154	5,186,478.02	0.17
1ASP	UNH	*	NA	1	8,357.66	0.00
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					6,543,541.75	0.22
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,028,234,652.37	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.733%

Limite 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