

gbmfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 02 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0011841		154,751	154,751.00	0.01
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,721,754.41	0.06
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,876,505.41	0.06
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	SHW	*	NA	6,581	40,564,052.69	1.34
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	NA	6,574	19,388,866.30	0.64
1ASP	AME	*	NA	5,302	14,377,530.27	0.48
1ASP	CPRT	*	NA	12,849	37,216,010.89	1.23
1ASP	IEX	*	NA	3,465	15,512,807.56	0.51
1ASP	ROP	*	NA	4,777	46,378,718.24	1.54
1ASP	TREX1	*	NA	5,434	12,394,032.45	0.41
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	AMZN	*	ALTA	2,280	157,657,706.85	5.22
1ASP	CHGG	*	NA	12,345	20,762,072.96	0.69
1ASP	DPZ	*	NA	1,975	20,399,240.62	0.68
1ASP	ETSY	*	NA	6,012	25,627,682.04	0.85
1ASP	HD	*	ALTA	13,772	90,123,755.64	2.99
1ASP	NKE	*	NA	28,975	94,690,267.84	3.14
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	COST	*	ALTA	8,440	77,683,346.64	2.57
1ASP	MNST	*	NA	36,155	70,458,111.98	2.34
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ABMD	*	NA	2,546	18,800,671.22	0.62
1ASP	ALGN	*	NA	3,443	50,118,174.14	1.66
1ASP	EW	*	NA	25,021	60,256,069.37	2.00
1ASP	ILMN	*	NA	1,762	16,519,287.73	0.55
1ASP	ISRG	*	NA	4,368	93,454,406.18	3.10
1ASP	UNH	*	NA	13,862	117,275,535.96	3.89
1ASP	VEEV	*	NA	2,828	17,840,081.62	0.59
1ASP	VRTX	*	NA	15,163	60,315,771.70	2.00
1ASP	ZTS	*	NA	26,157	109,270,756.07	3.62
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	MKTX	*	NA	797	7,630,141.26	0.25
1ASP	V	*	ALTA	29,893	133,807,108.18	4.43
1ISP	BIL	*	ALTA	132,460	241,922,492.17	8.02
1ISP	IWF	*	NA	13,196	76,829,454.69	2.55
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	ADBE	*	NA	6,194	82,199,749.45	2.72
1ASP	ANET	*	NA	3,515	25,540,661.26	0.85
1ASP	APH	*	NA	15,349	23,549,422.43	0.78
1ASP	ASML	N	NA	2,518	43,116,289.09	1.43
1ASP	CGNX	*	NA	5,549	9,793,336.49	0.32
1ASP	EA	*	NA	8,216	23,852,705.99	0.79
1ASP	EPAM	*	NA	1,994	25,207,165.04	0.84
1ASP	FB	*	NA	21,757	163,029,895.29	5.40
1ASP	FTNT	*	NA	6,645	41,648,476.44	1.38
1ASP	GOOG	*	ALTA	4,483	258,186,798.51	8.56
1ASP	IPGP	*	NA	5,621	19,456,974.13	0.64
1ASP	MSFT	*	ALTA	40,869	245,747,832.92	8.14
1ASP	NVDA	*	NA	13,085	58,513,624.95	1.94
1ASP	PYPL	*	NA	12,470	71,093,683.55	2.36
1ASP	QCOM	*	ALTA	26,195	75,902,921.19	2.52
1ASP	TXN	*	ALTA	2,152	8,138,755.26	0.27
1ASP	TYL	*	NA	1,426	13,850,947.37	0.46
1ASP	XLNX	*	NA	14,567	44,833,050.81	1.49
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	TTWO	*	NA	7,185	23,245,292.88	0.77
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					3,004,181,736.31	99.56
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,004,181,736.31	99.56
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211216	mxAAA	310,706	3,061,455.88	0.10
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,061,455.88	0.10
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ASP	COST	*	ALTA	100	920,418.80	0.03
1ASP	DPZ	*	NA	100	1,032,872.94	0.03
1ASP	ETSY	*	NA	100	426,275.48	0.01
1ASP	NVDA	*	NA	1,027	4,592,548.17	0.15
1ASP	UNH	*	NA	100	846,021.76	0.03
1ASP	UNH	*	NA	1	8,460.22	0.00
1ISP	IWF	*	NA	100	582,217.75	0.02
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					8,408,815.12	0.28
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,017,528,512.72	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.729%

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