

gbmfondos

GBMINT GBM INVERSIONES INTERNACIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 02 MAYO, 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	1,603,104.64	0.19
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,603,104.64	0.19
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	SHW	*	NA	2,500	21,638,757.68	2.50
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	NA	8,150	15,415,311.96	1.78
1ASP	AME	*	NA	3,300	5,490,901.09	0.63
1ASP	AOS	*	NA	6,000	6,025,409.52	0.70
1ASP	CPRT	*	NA	11,500	14,675,558.71	1.69
1ASP	FAST	*	NA	2,500	3,339,004.63	0.39
1ASP	IEX	*	NA	1,750	5,198,282.86	0.60
1ASP	LII	*	NA	640	3,256,138.04	0.38
1ASP	ROP	*	NA	1,725	11,795,639.73	1.36
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	BKNG	*	NA	845	29,212,298.96	3.37
1ASP	BURL	*	NA	2,000	6,522,173.10	0.75
1ASP	HD	*	ALTA	7,500	28,826,341.58	3.33
1ASP	NKE	*	NA	15,000	24,456,715.05	2.82
1ASP	TJX	*	ALTA	12,950	13,482,742.93	1.56
1ASP	ULTA	*	NA	2,475	16,264,475.57	1.88
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	COST	*	ALTA	5,350	24,826,543.87	2.87
1ASP	DLTR	*	NA	1,750	3,662,388.54	0.42
1ASP	MNST	*	NA	26,000	28,829,496.54	3.33
1ASP	STZ	*	ALTA	2,700	10,796,175.50	1.25
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	BIIB	*	NA	2,825	12,451,958.50	1.44
1ASP	EW	*	NA	6,190	21,146,017.15	2.44
1ASP	ISRG	*	NA	2,500	24,002,113.28	2.77
1ASP	MTD	*	NA	555	7,993,075.15	0.92
1ASP	REGN	*	NA	2,400	15,392,099.06	1.78
1ASP	SYK	*	NA	4,000	14,444,003.40	1.67
1ASP	UNH	*	NA	9,250	41,113,257.16	4.75
1ASP	VRTX	*	NA	5,250	17,019,315.29	1.97
1ASP	ZTS	*	NA	14,500	28,598,801.68	3.30
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	MKTX	*	NA	675	3,651,427.42	0.42
1ASP	V	*	ALTA	13,400	41,282,391.97	4.77
1ASP	VEEV	*	NA	800	2,155,472.09	0.25
1ISP	BIL	*	ALTA	39,770	69,534,832.02	8.03
1ISP	SPY	*	ALTA	500	2,783,826.39	0.32
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	AAPL	*	ALTA	3,750	14,996,839.31	1.73
1ASP	ADBE	*	NA	2,500	13,367,491.10	1.54
1ASP	ANET	*	NA	3,450	20,505,981.83	2.37
1ASP	ANSS	*	NA	1,000	3,659,376.98	0.42
1ASP	APH	*	NA	2,750	5,213,053.84	0.60
1ASP	CGNX	*	NA	3,700	3,415,698.96	0.39
1ASP	CRM	*	NA	1,300	4,022,656.86	0.46
1ASP	EA	*	NA	7,000	12,635,156.80	1.46
1ASP	FB	*	NA	9,700	35,709,251.46	4.12
1ASP	GOOG	*	ALTA	2,900	64,467,770.85	7.44
1ASP	IPOG	*	NA	1,300	4,220,520.97	0.49
1ASP	MSFT	*	ALTA	19,550	47,179,260.57	5.45
1ASP	PAYC	*	NA	900	3,467,077.08	0.40
1ASP	PYPL	*	NA	11,000	23,073,310.70	2.66
1ASP	TXN	*	ALTA	1,500	3,368,928.99	0.39
1ASP	XLNX	*	NA	8,850	20,120,359.07	2.32
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	SPGI	*	NA	950	3,944,882.19	0.46
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					858,650,563.98	99.16
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
EAIM	GBM-INT	0011841		111,902	111,902.00	0.01
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					111,902.00	0.01
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					858,762,465.98	99.17
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	200924	mxAAA	25,034	2,495,386.47	0.29
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,495,386.47	0.29
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ASP	FB	*	NA	600	2,208,819.68	0.26
1ASP	MSFT	*	ALTA	200	482,652.28	0.06
1ISP	BIL	*	ALTA	230	402,137.58	0.05
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					3,093,609.54	0.36
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					865,954,566.63	100.00

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.985%

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 período 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