

GBMfondos

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

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,754,211.55	0.05
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,754,211.55	0.05
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	SHW	*	ALTA	4,477	32,332,541.21	0.95
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	ALTA	6,396	17,371,621.07	0.51
1ASP	AME	*	ALTA	5,739	17,305,511.45	0.51
1ASP	CPRT	*	ALTA	16,721	51,991,393.70	1.53
1ASP	IEX	*	ALTA	3,465	16,792,541.77	0.49
1ASP	ROP	*	ALTA	5,236	52,814,584.02	1.55
1ASP	TREX1	*	ALTA	5,434	15,047,440.06	0.44
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	AMZN	*	ALTA	2,404	164,383,062.03	4.84
1ASP	DPZ	*	ALTA	2,075	24,013,968.76	0.71
1ASP	ETSY	*	ALTA	4,558	20,465,019.12	0.60
1ASP	HD	*	ALTA	13,355	113,661,968.71	3.35
1ASP	NKE	*	ALTA	25,290	86,440,841.28	2.54
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	COST	*	ALTA	9,077	105,675,412.05	3.11
1ASP	MNST	*	ALTA	33,912	66,791,050.65	1.97
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ABMD	*	ALTA	2,546	18,753,018.16	0.55
1ASP	ALGN	*	ALTA	4,012	54,070,200.83	1.59
1ASP	EW	*	ALTA	24,385	64,784,766.45	1.91
1ASP	ILMN	*	ALTA	1,981	15,455,511.01	0.46
1ASP	ISRG	*	ALTA	12,505	92,141,151.10	2.71
1ASP	UNH	*	ALTA	13,066	134,548,912.63	3.96
1ASP	VEEV	*	ALTA	4,159	21,790,066.12	0.64
1ASP	VRTX	*	ALTA	15,529	69,934,028.46	2.06
1ASP	ZTS	*	ALTA	27,196	136,100,892.34	4.01
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	V	*	ALTA	34,468	153,182,007.44	4.51
1ISP	BIL	*	ALTA	130,546	244,773,844.65	7.21
1ISP	IWF	*	ALTA	15,422	96,647,930.16	2.85
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	ADBE	*	ALTA	7,408	86,147,505.69	2.54
1ASP	ANET	*	ALTA	16,758	49,401,798.47	1.45
1ASP	APH	*	ALTA	16,223	29,097,344.87	0.86
1ASP	ASML	N	ALTA	2,309	38,056,398.23	1.12
1ASP	CGNX	*	ALTA	5,549	8,848,786.10	0.26
1ASP	EA	*	ALTA	7,140	19,313,266.25	0.57
1ASP	EPAM	*	ALTA	2,810	38,520,149.83	1.13
1ASP	FB	*	ALTA	19,429	134,015,367.16	3.95
1ASP	FTNT	*	ALTA	5,599	41,266,844.40	1.21
1ASP	GOOG	*	ALTA	4,626	274,508,213.58	8.08
1ASP	IPGP	*	ALTA	5,968	21,068,001.15	0.62
1ASP	MSFT	*	ALTA	43,007	296,622,822.78	8.73
1ASP	NVDA	*	ALTA	14,882	89,760,200.00	2.64
1ASP	PINS	*	ALTA	13,060	9,735,545.98	0.29
1ASP	PTC	*	ALTA	7,876	19,567,793.03	0.58
1ASP	PYPL	*	ALTA	14,907	57,649,905.95	1.70
1ASP	QCOM	*	ALTA	33,346	125,054,386.78	3.68
1ASP	TXN	*	ALTA	2,152	8,317,584.43	0.24
1ASP	TYL	*	ALTA	1,587	17,507,799.27	0.52
1ASP	XLNX	*	ALTA	15,406	66,988,449.70	1.97
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	TTWO	*	ALTA	7,401	26,973,632.05	0.79
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					3,345,691,081.93	98.50
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
EAIM	GBM-INT	0011841		161,909	161,909.00	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					161,909.00	0.00
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,345,852,990.93	98.50
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	146,074	14,550,859.35	0.43
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					14,550,859.35	0.43
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ASP	FB	*	ALTA	5,000	34,488,488.13	1.02
1ASP	QCOM	*	ALTA	1	3,750.21	0.00
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					34,492,238.34	1.02
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,396,650,300.17	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.315%

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