

# GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0003848		703,913	703,913.00	0.64
TOTAL DISPONIBILIDADES					703,913.00	0.64
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	CAT	*	ALTA	664	2,844,983.65	2.60
1ASP	FDX	*	ALTA	524	3,082,522.07	2.82
1ASP	RTX	*	NA	2,479	4,418,507.24	4.04
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	FOTOLUZ	B	NULA	100,000	0.10	0.00
1ASP	AMZN	*	ALTA	75	5,353,322.85	4.90
1ASP	LOW	*	NA	1,003	3,833,558.74	3.51
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ALGN	*	NA	433	5,432,671.37	4.97
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	BLK	*	NA	357	6,344,966.83	5.80
1ASP	COF	*	NA	1,431	4,494,907.77	4.11
1ASP	GS	*	ALTA	893	6,603,757.10	6.04
1ASP	MS	*	ALTA	3,357	6,036,996.88	5.52
1ISP	OEF	*	ALTA	56	220,532.53	0.20
1ISP	QQQ	*	NA	30	211,933.43	0.19
1ISP	SHV	*	ALTA	182	411,382.06	0.38
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	AAPL	*	ALTA	1,934	5,213,990.77	4.77
1ASP	AMAT	*	ALTA	2,291	6,435,617.35	5.89
1ASP	ASML	N	NA	419	6,021,402.14	5.51
1ASP	AVGO	*	NA	546	5,262,615.05	4.81
1ASP	FB	*	NA	675	4,646,576.35	4.25
1ASP	GOOG	*	ALTA	102	5,273,621.06	4.82
1ASP	LRCX	*	NA	414	5,418,291.06	4.96
1ASP	MSFT	*	ALTA	1,117	5,961,541.65	5.45
1ASP	NVDA	*	NA	479	7,312,644.58	6.69
1ASP	PYPL	*	NA	986	5,609,509.01	5.13
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					106,445,851.64	97.36
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					106,445,851.64	97.36
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	230209	mxAAA	21,974	2,186,803.82	2.00
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					2,186,803.82	2.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					109,336,568.46	100.00

CATEGORÍA  
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
1.970%

Límite de VaR  
2.720%

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

Ing. Fernando Castro Tapia