

GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0003848		683,389	683,389.00	0.53
TOTAL DISPONIBILIDADES					683,389.00	0.53
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	FOTOLUZ	B	NULA	100,000	0.10	0.00
1ASP	AMZN	*	ALTA	84	5,800,933.62	4.48
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	ALGN	*	NA	465	6,562,449.32	5.06
1ASP	ISRG	*	NA	209	4,341,539.05	3.35
1ASP	MRNA	*	NA	849	7,328,626.16	5.66
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	BLK	*	NA	398	7,193,205.65	5.55
1ASP	GS	*	ALTA	997	7,962,185.14	6.15
1ASP	MS	*	ALTA	3,748	7,673,093.90	5.92
1ISP	OEF	*	ALTA	56	229,470.05	0.18
1ISP	QQQ	*	NA	30	225,338.59	0.17
1ISP	SHV	*	ALTA	182	399,466.92	0.31
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	AAPL	*	ALTA	2,159	6,392,804.52	4.93
1ASP	ADBE	*	NA	315	4,137,420.41	3.19
1ASP	ADSK	*	NA	699	3,980,601.92	3.07
1ASP	AMAT	*	ALTA	2,558	7,177,820.28	5.54
1ASP	ASML	N	NA	419	7,324,365.62	5.65
1ASP	AVGO	*	NA	610	6,177,939.21	4.77
1ASP	CDW	*	NA	1,348	5,225,044.36	4.03
1ASP	FB	*	NA	753	5,594,209.83	4.32
1ASP	GOOG	*	ALTA	113	6,520,157.43	5.03
1ASP	INTU	*	NA	371	4,217,144.96	3.25
1ASP	MSFT	*	ALTA	1,246	7,546,169.95	5.82
1ASP	NVDA	*	NA	2,142	9,507,955.84	7.34
1ASP	SNPS	*	NA	715	4,774,486.98	3.68
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					126,292,429.81	97.47
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					126,292,429.81	97.47
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211118	mxAAA	261,323	2,591,782.79	2.00
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,591,782.79	2.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					129,567,601.60	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.882%

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