

# GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, 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
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>						
EAIM	GBM-INT	0003848		686,827	686,827.00	0.51
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>686,827.00</b>	<b>0.51</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	FOTOLUZ	B	NULA	100,000	0.10	0.00
1ASP	AMZN	*	ALTA	83	5,739,293.71	4.22
<b>EMPRESAS DE SALUD</b>						
1ASP	ALGN	*	NA	465	6,768,792.03	4.98
1ASP	ISRG	*	NA	209	4,471,605.06	3.29
1ASP	MRNA	*	NA	838	6,653,784.71	4.90
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
1ASP	BLK	*	NA	393	7,459,936.96	5.49
1ASP	COF	*	NA	1,577	5,039,962.72	3.71
1ASP	GS	*	ALTA	984	8,143,900.36	5.99
1ASP	MS	*	ALTA	3,698	7,740,433.98	5.70
1ISP	OEF	*	ALTA	56	233,000.51	0.17
1ISP	QQQ	*	NA	30	227,863.40	0.17
1ISP	SHV	*	ALTA	182	401,483.66	0.30
<b>EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN</b>						
1ASP	AAPL	*	ALTA	2,130	6,534,689.94	4.81
1ASP	ADBE	*	NA	311	4,127,239.60	3.04
1ASP	ADSK	*	NA	690	3,960,540.31	2.91
1ASP	AMAT	*	ALTA	2,524	6,775,837.39	4.99
1ASP	ASML	N	NA	419	7,174,632.70	5.28
1ASP	AVGO	*	NA	602	5,912,703.91	4.35
1ASP	CDW	*	NA	1,348	5,470,847.78	4.03
1ASP	FB	*	NA	743	5,567,459.31	4.10
1ASP	GOOG	*	ALTA	112	6,450,350.53	4.75
1ASP	INTU	*	NA	371	4,146,788.29	3.05
1ASP	MSFT	*	ALTA	1,230	7,396,066.32	5.44
1ASP	NVDA	*	NA	2,114	9,453,404.90	6.96
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>125,850,618.18</b>	<b>92.61</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>125,850,618.18</b>	<b>92.61</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	211216	mxAAA	949,245	9,353,123.83	6.88
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>9,353,123.83</b>	<b>6.88</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>135,890,569.01</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
DISCRECIONAL

**CALIFICACIÓN**

**VaR Promedio**  
1.925%

**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