

GBMfondos

GBMALFA GBM MEXICO ALFA, S.A. de C. V. Fondo de Inversión de Renta Variable CARTERA DE VALORES AL 29 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	400,000	16,932,000.00	3.10
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	1,084,000	58,427,600.00	10.69
1	FEMSA	UBD	ALTA	281,000	50,256,850.00	9.19
1	GMEXICO	B	ALTA	396,000	38,918,880.00	7.12
1	PINFRA	*	ALTA	185,000	36,086,100.00	6.60
1	AMX	B	ALTA	2,168,859	32,988,345.39	6.03
1	ASUR	B	ALTA	61,000	31,664,490.00	5.79
1	GCC	*	ALTA	134,281	24,307,546.62	4.45
1	OMA	B	ALTA	131,000	20,732,060.00	3.79
1	CUERVO	*	ALTA	751,187	19,673,587.53	3.60
1	LACOMER	UBC	ALTA	585,500	19,221,965.00	3.52
1	KIMBER	A	ALTA	699,000	19,110,660.00	3.49
1	ALFA	A	ALTA	1,118,127	17,297,424.69	3.16
1	KOF	UBL	ALTA	96,990	15,621,209.40	2.86
1	VESTA	*	ALTA	265,590	12,849,244.20	2.35
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,067,000	11,886,380.00	2.17
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	109,000	11,112,550.00	2.03
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				6,111,759	25,656,237.67	4.69
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					462,743,130.50	84.62
PRESTAMO DE VALORES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,000,000	22,280,000.00	4.07
1	GFNORTE	O	ALTA	134,390	18,186,998.70	3.33
1	GFNORTE	O	ALTA	120,000	16,239,600.00	2.97
OTROS VALORES				1,392,808	27,369,711.15	5.01
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					546,819,440.35	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					56,706,598.70	10.37

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.343%

Limite de VaR
4.380%

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