

GBMfondos

GBMALFA GBM MEXICO ALFA, S.A. de C. V. Fondo de Inversión de Renta Variable CARTERA DE VALORES AL 11 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	400,000	17,672,000.00	3.11
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	1,084,000	61,896,400.00	10.89
1	FEMSA	UBD	ALTA	281,000	50,501,320.00	8.89
1	GMEXICO	B	ALTA	409,374	43,315,862.94	7.62
1	ASUR	B	ALTA	69,000	36,932,940.00	6.50
1	PINFRA	*	ALTA	189,944	35,371,371.68	6.23
1	AMX	B	ALTA	2,183,363	33,449,121.16	5.89
1	GCC	*	ALTA	134,281	24,918,525.17	4.39
1	CUERVO	*	ALTA	743,758	19,174,081.24	3.37
1	LACOMER	UBC	ALTA	496,761	17,048,837.52	3.00
1	ALFA	A	ALTA	1,030,127	15,987,571.04	2.81
1	OMA	B	ALTA	75,677	13,909,432.60	2.45
1	R	A	ALTA	113,656	13,803,521.20	2.43
1	NEMAK	A	MEDIA	5,328,000	11,828,160.00	2.08
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,169,314	36,128,198.44	6.36
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					431,937,342.99	76.02
PRESTAMO DE VALORES						
1	GFNORTE	O	ALTA	200,000	27,984,000.00	4.93
1	VESTA	*	ALTA	490,000	24,681,300.00	4.34
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,600,000	17,792,000.00	3.13
1	GFNORTE	O	ALTA	105,032	14,696,077.44	2.59
1	KIMBER	A	ALTA	500,000	14,005,000.00	2.47
OTROS VALORES				1,490,942	37,066,878.52	6.52
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					568,162,598.95	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					99,158,377.44	17.45

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.368%

Límite 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