

GBMfondos

GBMALFA GBM MEXICO ALFA, S.A. de C. V. Fondo de Inversión de Renta Variable CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	1,008,000	55,480,320.00	10.24
1	FEMSA	UBD	ALTA	253,000	47,133,900.00	8.70
1	GMEXICO	B	ALTA	376,000	38,491,120.00	7.11
1	AMX	B	ALTA	2,370,000	36,545,360.00	6.75
1	PINFRA	*	ALTA	178,000	30,993,360.00	5.72
1	ASUR	B	ALTA	57,000	30,656,310.00	5.66
1	GFNORTE	O	ALTA	190,000	27,318,200.00	5.04
1	GCC	*	ALTA	142,999	25,639,720.70	4.73
1	VESTA	*	ALTA	419,000	21,586,880.00	3.99
1	OMA	B	ALTA	118,000	19,809,840.00	3.66
1	ALFA	A	ALTA	1,118,127	17,342,149.77	3.20
1	LACOMER	UBC	ALTA	479,000	16,832,060.00	3.11
1	CUERVO	*	ALTA	634,000	16,610,800.00	3.07
1	KIMBER	A	ALTA	588,000	16,558,080.00	3.06
1	AC	*	ALTA	91,800	15,392,106.00	2.84
1	ALPEK	A	MEDIA	1,068,000	14,503,440.00	2.68
1	KOF	UBL	ALTA	71,000	11,225,810.00	2.07
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				5,098,935	36,291,509.60	6.70
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					478,411,006.07	88.33
PRESTAMO DE VALORES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,000,000	21,920,000.00	4.05
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,000,000	10,960,000.00	2.02
OTROS VALORES				1,368,092	30,336,467.84	5.60
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					541,627,473.91	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					32,880,000.00	6.07

CATEGORÍA	CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
RVDIS		1.343%	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