

GBMfondos

GBMALFA GBM MEXICO ALFA, S.A. de C. V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	1,020,000	56,120,400.00	10.41
1	FEMSA	UBD	ALTA	248,000	48,169,040.00	8.94
1	AMX	B	ALTA	2,467,000	39,003,270.00	7.24
1	CEMEX	CPO	ALTA	3,434,000	36,194,360.00	6.72
1	GFNORTE	O	ALTA	220,000	30,652,600.00	5.69
1	ASUR	B	ALTA	57,000	30,504,690.00	5.66
1	PINFRA	*	ALTA	174,500	30,455,485.00	5.65
1	GMEXICO	B	ALTA	275,000	28,789,750.00	5.34
1	GCC	*	ALTA	168,000	27,491,520.00	5.10
1	VESTA	*	ALTA	435,000	22,746,150.00	4.22
1	OMA	B	ALTA	117,000	19,610,370.00	3.64
1	CUERVO	*	ALTA	614,000	16,148,200.00	3.00
1	LACOMER	UBC	ALTA	435,000	15,742,650.00	2.92
1	ALFA	A	ALTA	933,000	13,528,500.00	2.51
1	ALPEK	A	MEDIA	1,026,000	13,327,740.00	2.47
1	BIMBO	A	ALTA	183,000	11,375,280.00	2.11
	OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS			4,705,744	37,570,130.48	6.97
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FMTY	14	ALTA	1,071,000	11,084,850.00	2.06
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					488,514,985.48	90.64
PRESTAMO DE VALORES						
1	KIMBER	A	ALTA	474,712	13,638,475.76	2.53
1	AC	*	ALTA	78,000	13,362,180.00	2.48
OTROS VALORES					710,074	4.36
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					538,991,019.10	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					27,000,655.76	5.01

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA	Límite de VaR
	RVDIS	
	VaR Promedio	
	1.356%	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