

GBMfondos

GBMALFA GBM MEXICO ALFA, S.A. de C. V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 31 MARZO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	1,231,519	68,472,456.40	4.08
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ASP	TBBB	N	ALTA	94,048	59,627,779.14	3.55
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	FEMSA	UBD	ALTA	653,556	129,332,196.84	7.71
1	PINFRA	*	ALTA	404,438	117,210,176.78	6.98
1	GFNORTE	O	ALTA	582,500	115,789,350.00	6.90
1	ASUR	B	ALTA	164,868	99,581,920.68	5.93
1	GCC	*	ALTA	499,037	95,131,423.31	5.67
1	AMX	B	ALTA	3,863,170	88,003,012.60	5.24
1	WALMEX	*	ALTA	1,375,878	80,076,099.60	4.77
1	VESTA	*	ALTA	1,210,050	72,615,100.50	4.33
1	GMEXICO	B	ALTA	338,119	64,891,798.48	3.87
1	ALSEA	*	ALTA	1,102,734	63,793,161.90	3.80
1	GAP	B	ALTA	118,313	52,312,092.95	3.12
1	LACOMER	UBC	ALTA	1,214,453	51,711,408.74	3.08
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,323,855	47,755,220.25	2.85
1	ORBIA	*	ALTA	1,857,000	40,092,630.00	2.39
1	ESENTIA	II	MEDIA	680,109	37,072,741.59	2.21
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	1,704,788	49,728,665.96	2.96
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,444,674,691.51	86.07
PRESTAMO DE VALORES						
1	GMEXICO	B	ALTA	400,000	76,768,000.00	4.57
OTROS VALORES					157,066,591.61	9.36
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,678,509,283.12	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					76,768,000.00	4.57

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.356%

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