

gbmfondos

GBMALFA GBM MEXICO ALFA, S.A. de C. V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 13 AGOSTO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	739,759	41,722,407.60	2.20
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ASP	TX	*	ALTA	65,500	60,594,015.15	3.19
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	GMEXICO	B	ALTA	721,244	158,392,394.84	8.34
1	PINFRA	*	ALTA	543,000	142,206,270.00	7.48
1	CEMEX	CPO	ALTA	5,546,523	105,217,541.31	5.54
1	GCC	*	ALTA	500,924	97,820,438.72	5.15
1	GFNORTE	O	ALTA	431,973	83,029,530.33	4.37
1	OMA	B	ALTA	336,011	76,963,319.55	4.05
1	VESTA	*	ALTA	1,273,276	73,633,551.08	3.88
1	GAP	B	ALTA	205,436	73,217,390.40	3.85
1	GENTERA	*	ALTA	1,833,307	70,912,314.76	3.73
1	ASUR	B	ALTA	152,077	69,312,134.29	3.65
1	AC	*	ALTA	344,689	66,487,061.21	3.50
1	AMX	B	ALTA	3,330,000	66,167,100.00	3.48
1	MEGA	CPO	ALTA	1,050,911	59,082,216.42	3.11
1	KIMBER	A	ALTA	1,412,600	55,557,558.00	2.92
1	ESENTIA	II	MEDIA	940,363	50,281,209.61	2.65
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				6,947,467	183,688,886.62	9.67
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	2,323,088	68,020,016.64	3.58
OTROS TIPO DE VALOR CF - FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA				2,002,283	41,512,728.57	2.18
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,643,818,085.10	86.51
PRESTAMO DE VALORES						
1	FEMSA	UBD	ALTA	200,000	39,648,000.00	2.09
OTROS VALORES				5,517,159	216,616,060.46	11.40
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,900,082,145.56	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					39,648,000.00	2.09

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.395%

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