

# GBMfondos

## GBMALFA GBM MEXICO ALFA, S.A. de C. V. Fondo de Inversión de Renta Variable CARTERA DE VALORES AL 19 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES DE BANCOS</b>						
41	BBAJIO	O	ALTA	480,000	20,347,200.00	3.62
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	FEMSA	UBD	ALTA	291,000	50,089,830.00	8.91
1	GMEXICO	B	ALTA	458,374	44,663,962.56	7.95
1	PINFRA	*	ALTA	199,154	35,120,807.90	6.25
1	OMA	B	ALTA	147,010	26,767,580.80	4.76
1	VESTA	*	ALTA	516,000	26,635,920.00	4.74
1	GCC	*	ALTA	134,281	24,236,377.69	4.31
1	LACOMER	UBC	ALTA	657,675	22,150,494.00	3.94
1	ALFA	A	ALTA	1,146,000	17,063,940.00	3.04
1	WALMEX	*	ALTA	272,000	15,784,160.00	2.81
1	GFNORTE	O	ALTA	107,000	14,124,000.00	2.51
1	R	A	ALTA	98,519	11,639,034.66	2.07
1	NEMAK	A	MEDIA	4,900,000	11,466,000.00	2.04
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,455,184	53,525,272.10	9.52
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>373,614,579.71</b>	<b>66.48</b>
<b>PRESTAMO DE VALORES</b>						
1	WALMEX	*	ALTA	700,000	40,621,000.00	7.23
1	GFNORTE	O	ALTA	250,000	33,000,000.00	5.87
1	ASUR	B	ALTA	59,967	32,055,959.52	5.70
1	AMX	B	ALTA	1,700,000	24,718,000.00	4.40
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,000,000	22,680,000.00	4.04
1	KIMBER	A	ALTA	500,000	13,975,000.00	2.49
<b>OTROS VALORES</b>				819,994	<b>21,321,532.01</b>	<b>3.79</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>561,986,071.24</b>	<b>100.00</b>
<b>TOTAL PRESTAMO DE VALORES</b>					<b>167,049,959.52</b>	<b>29.72</b>

### CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
1.373%

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