



# FinanciacialGuru

**Analisis conjunto: activos con mejor  
desempeño en el semestre**

## ¡Bienvenidos a Financial Guru!

Este documento presenta un análisis financiero estructurado enfocado en identificar, evaluar y describir un conjunto selecto de activos que destacan por su desempeño en términos de crecimiento en precios y rendimiento sobre capital (ROE). Elaborado por *Financial Guru*, este reporte integra una visión tanto agregada como individual de los activos seleccionados, empleando una metodología automatizada que combina reportería inteligente, business intelligence e inteligencia artificial.

Es importante señalar que este informe no constituye una recomendación de inversión, sino que se ofrece como una herramienta informativa y analítica para apoyar procesos de evaluación y comparación entre activos bursátiles.

---

## Propósito y alcance

El objetivo principal del informe es proporcionar al lector una visión comprensiva de un conjunto de activos destacados por sus niveles superiores de crecimiento y eficiencia financiera. A partir de estos criterios, se realiza un análisis conjunto para comprender el comportamiento general del grupo, y un análisis individual, que permite profundizar en los aspectos particulares de cada uno.

Esta dualidad busca ofrecer al lector un entendimiento holístico que facilite la detección de patrones compartidos, fortalezas individuales y oportunidades de análisis más profundo.

---

## Contenido del reporte

El informe está estructurado en dos bloques principales:

### 1. Análisis conjunto de activos

Se inicia con una sección que presenta una visión consolidada del comportamiento del grupo de activos seleccionados. Aquí se analizan:

- **Rendimientos acumulados** en diversos horizontes temporales.
- **Promedios y dispersión de indicadores financieros** como crecimiento porcentual, ROE, y otros.
- **Distribución sectorial** y participación relativa por tamaño de mercado.

Esta parte busca identificar si existen patrones comunes, como sectores predominantes o niveles similares de eficiencia, que puedan explicar el alto desempeño del grupo.

### 2. Análisis individual de activos

Cada activo es analizado por separado, presentando:

- Sus métricas de crecimiento reciente en distintas ventanas de tiempo (mensual, trimestral, semestral, anual).

- Su posición en cuanto a ROE comparado con otros activos del mercado.
  - Visualizaciones gráficas de evolución de precio y variaciones acumuladas.
  - Síntesis cualitativa y cuantitativa de su comportamiento, sin emitir juicios ni recomendaciones.
- 

## Criterios de selección

Los activos incluidos en este informe fueron seleccionados utilizando dos criterios clave:

- **Crecimiento en precio acumulado:** Se consideran activos que han mostrado un desempeño sobresaliente en cuanto a incremento de valor en diversos periodos.
- **ROE superior al promedio del mercado:** El retorno sobre capital es empleado como métrica de eficiencia en el uso de recursos financieros.

Esta combinación permite destacar activos que no solo han tenido un buen rendimiento de mercado, sino que lo han hecho con fundamentos financieros relativamente sólidos.

---

## Metodología

El informe ha sido generado mediante una arquitectura automatizada que integra:

- **Procesamiento de datos financieros históricos** provenientes de fuentes oficiales del mercado.
- **Algoritmos de filtrado y selección automática** basados en métricas clave.
- **Visualización con herramientas de BI**, para facilitar la interpretación de los datos.

Gracias a esta metodología, el reporte logra mantener un alto nivel de consistencia, claridad y objetividad, reduciendo la intervención humana y asegurando replicabilidad.

---

## Consideraciones finales

Este reporte representa una herramienta útil para quienes buscan identificar tendencias de crecimiento sostenido y eficiencia financiera en activos bursátiles. Sin embargo, se reitera que este documento no constituye una recomendación de inversión, sino un insumo informativo para quienes deseen iniciar o complementar un análisis más profundo y personalizado.

Agradecemos su lectura y confianza en *Financial Guru*, y reafirmamos nuestro compromiso con el desarrollo de herramientas tecnológicas que impulsen una cultura financiera sólida y basada en datos objetivos.

## Top 15 activos por crecimiento

Generado el 28/6/2025 a las 09:29 a.m.

Ordenar por:   Tipo de activo:

Activo	Último Precio	Diario	Semanal	Quincenal	Mensual	Semestral	Anual
GENTERA.MX	39.98	2.07%	3.04%	-2.23%	5.21%	66.44%	71.51%
OMAB.MX	241.06	-1.50%	2.14%	-4.20%	3.91%	36.40%	54.42%
FSHOP13.MX	9.20	0.00%	5.50%	4.78%	4.31%	8.62%	50.08%
CIEB.MX	33.38	0.00%	2.99%	2.99%	3.02%	21.38%	45.13%
PINFRA.MX	215.00	0.67%	1.11%	-2.71%	-2.52%	21.46%	26.51%
ALFAA.MX	13.51	-2.31%	0.15%	-8.96%	-9.15%	-9.45%	26.26%
LABB.MX	20.90	1.65%	-0.90%	-4.39%	-6.32%	-18.65%	24.78%
GMEXICOB.MX	113.55	4.59%	8.13%	6.49%	7.11%	14.80%	17.68%
GFNORTEO.MX	173.40	-0.62%	2.72%	0.67%	-1.14%	28.44%	16.22%
FUNO11.MX	25.81	-0.77%	0.58%	-2.64%	-1.79%	24.15%	15.38%
KOFUBL.MX	176.46	1.41%	-4.09%	-4.59%	-4.38%	10.47%	14.97%
MEGACPO.MX	52.07	-0.71%	0.50%	-5.76%	6.92%	53.15%	13.44%
GFINBURO.MX	49.16	0.99%	4.53%	3.06%	-4.40%	13.80%	11.78%
CEMEXCPO.MX	12.96	1.33%	0.39%	-1.97%	-6.56%	12.89%	11.72%
AC.MX	198.74	1.32%	-1.71%	-2.67%	-6.68%	13.71%	11.34%

Dow Jones

42427.74

Mensual

-0.22%

Anual

-0.53%

S&P 500

5970.81

Mensual

+0.01%

Anual

+0.21%

Fed Funds Rate

4.33%

Mensual

+0.00%

Anual

-18.76%

GDP Growth

-0.20%

Mensual

-108.33%

Anual

-80.00%

Housing Starts

1361.00

Mensual

+1.64%

Anual

-1.73%

MSCI Mexico

60.25

Mensual

-0.23%

Anual

+1.24%

MSCI World

165.12

Mensual

+0.12%

Anual

+0.98%

IPC Mexico

57484.52

Mensual

-0.27%

Anual

-1.72%

### Análisis de los Indicadores

El análisis de los cinco activos principales muestra un rendimiento anual notable, liderado por GENTERA.MX con un 71.51%, seguido de OMAB.MX con un 54.42%. Sin embargo, la volatilidad diaria es baja, excepto para OMAB.MX con una caída del 1.50%. FSHOP13.MX y CIEB.MX muestran rendimientos anuales sólidos pero sin cambios diarios, sugiriendo una consolidación de precios. PINFRA.MX, aunque con un rendimiento anual menor, presenta una mayor estabilidad. El contexto económico global es mixto. El Dow Jones y el IPC México muestran caídas anuales leves, mientras que el S&P 500 presenta un ligero crecimiento. La tasa de fondos federales se mantiene estable, pero con una fuerte disminución anual, reflejando una política monetaria menos restrictiva. El crecimiento del PIB es negativo, con una fuerte caída mensual, indicando una contracción económica. Las cifras de inicios de viviendas muestran una leve mejora mensual pero una disminución anual. Los índices MSCI México y MSCI World muestran un crecimiento anual moderado. La relación entre los indicadores macro y los rendimientos de los activos es compleja. El crecimiento anual positivo de algunos activos, a pesar del bajo crecimiento del PIB, podría atribuirse a factores específicos de la empresa o del sector. La caída del IPC México no se refleja completamente en los activos analizados, sugiriendo un comportamiento sectorial diferenciado. La baja tasa de fondos federales podría estar contribuyendo al rendimiento positivo de las acciones, aunque la contracción económica genera incertidumbre. En general, el mercado mexicano presenta una imagen contradictoria. Si bien algunos activos muestran un rendimiento excepcional, los indicadores macroeconómicos sugieren una economía débil. Se requiere un análisis más profundo para determinar si el rendimiento de los activos es sostenible a largo plazo, considerando la incertidumbre económica global y la situación específica de cada empresa. La volatilidad podría aumentar si la contracción económica persiste.

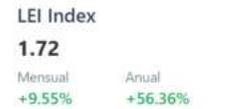
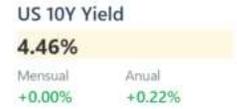
## Top 15 activos por indicadores fundamentales

Generado el 28/6/2025 a las 09:30 a.m.

Ordenar por:

Tipo de activo:

Activo	VlvsPA	EPS	ROE	ROA	PU	ENDEUD.	ROT.ACT.	VaR	Sharpe	Altman
OMAB.MX	4.99	13.30	0.49	0.19	18.12	0.61	0.55	-0.04	0.00	3.63
ASURB.MX	243.66	45.17	0.22	0.16	13.11	0.26	0.37	-0.03	0.00	4.31
FIBRAMQ12.MX	226.29	13.91	0.24	0.16	2.23	0.32	0.07	-0.03	-0.01	2.93
SIMECB.MX	-178.74	-0.31	0.19	0.15	-558.06	0.21	0.45	-0.02	0.02	6.16
KIMBERA.MX	11.55	2.47	1.02	0.15	13.82	0.86	1.05	-0.03	-0.02	5.00
GRUMAB.MX	-295.79	1.51	0.28	0.12	214.38	0.57	1.42	-0.03	0.00	7.74
CIEB.MX	21.75	2.98	0.24	0.12	11.20	0.52	0.32	-0.03	0.01	2.84
ICHB.MX	240.18	22.28	0.13	0.11	7.72	0.14	0.46	-0.02	0.01	6.71
PINFRA.MX	244.35	24.83	0.14	0.11	8.66	0.22	0.22	-0.03	-0.01	4.26
WALMEX.MX	-6.42	3.09	0.23	0.11	20.58	0.53	1.97	-0.03	-0.01	10.04
GMEXICOB.MX	-104.67	0.48	0.16	0.10	236.56	0.37	0.45	-0.04	0.01	4.37
KOFUBL.MX	N/A	N/A	0.16	0.08	N/A	0.51	0.93	-0.02	-0.00	5.61
LABB.MX	9.63	1.65	0.15	0.07	12.67	0.53	0.82	-0.03	-0.01	5.32
FNOVA17.MX	-5.76	1.21	0.12	0.07	23.26	0.42	0.08	-0.01	-0.00	2.09
AC.MX	42.50	13.04	0.11	0.07	15.24	0.41	0.84	-0.02	0.01	5.47



### Análisis de los Indicadores

El análisis de los fundamentales revela una disparidad significativa entre los activos. KIMBERA.MX destaca con un ROE de 1.02, indicando una alta rentabilidad sobre el capital. Sin embargo, su ROA de 0.15 sugiere que esta rentabilidad podría estar menos relacionada con la eficiencia operativa y más con el apalancamiento financiero. OMAB.MX presenta un ROE alto (0.49), pero un Ratio Sharpe de 0.00, indicando una posible falta de relación riesgo-rendimiento. El resto de los activos muestran ROE y ROA moderados, con Ratios Sharpe cercanos a cero o negativos, señalando una gestión de riesgo cuestionable o baja eficiencia en la generación de alfa. El VIX de 17.61 indica una volatilidad relativamente baja, sugiriendo un mercado relativamente tranquilo. La tasa del bono del Tesoro a 10 años de Estados Unidos (US 10Y Yield) en 4.46% refleja un entorno de tasas moderadamente altas, lo que podría afectar la valoración de las empresas. La inflación (CPI) de 320.32% es una cifra evidentemente errónea; es probable que se trate de un error de dato, ya que representa un valor absurdamente alto. Si este dato fuera correcto, implicaría un escenario hiperinflacionario con graves consecuencias para la economía y las inversiones. Asumiendo un error en el dato, la información restante sobre inflación indica un entorno de inflación moderada. En general, considerando los datos (corrigiendo el error en el CPI), se recomienda precaución. KIMBERA.MX presenta el ROE más atractivo, pero su alta dependencia del apalancamiento requiere un análisis más profundo. La falta de alfa en la mayoría de los activos, junto con tasas moderadamente altas, sugiere una estrategia de inversión conservadora. Se recomienda una profunda investigación individual de cada activo antes de tomar cualquier decisión de inversión, incluyendo un análisis exhaustivo de la situación financiera y los riesgos específicos de cada compañía, verificando la corrección del dato del CPI.

## Resumen general de indicadores técnicos

Generado el 30/6/2025 a las 10:09 a.m.

Activo	Último Cierre	MA (20)	RSI (14)	MACD	Bollinger	Estocástico	Volumen	ADX	SAR	OBV	ATR	CCI	CMF	Momentum	Acciones
AC.MX	206.31 (-3.37%)	167.51 Neutral	67.01 Neutral	13.34 Neutral	155.80 / 210.23 Neutral	68.42 / 75.45 Neutral	0.22x Venta	19.15 Neutral	175.89 Neutral	763669960 Neutral	20.37 Neutral	117.78 Venta	0.06 Neutral	26.72 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
ASURB.MX	616.54 (-0.95%)	545.14 Neutral	55.04 Neutral	37.22 Neutral	445.77 / 644.51 Neutral	71.81 / 73.53 Venta	0.19x Compra	32.23 Compra	401.45 Neutral	162052072 Neutral	61.07 Neutral	142.95 Venta	0.11 Neutral	88.82 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
GFNORTEO.MX	171.20 (-0.48%)	155.51 Neutral	30.74 Neutral	4.17 Neutral	124.42 / 186.60 Neutral	76.34 / 57.96 Neutral	0.17x Venta	10.03 Neutral	131.06 Neutral	1805167584 Neutral	18.31 Neutral	81.70 Neutral	-0.14 Neutral	34.65 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
LABB.MX	21.83 (-2.63%)	20.42 Neutral	61.59 Neutral	1.97 Neutral	10.85 / 29.59 Neutral	54.18 / 63.06 Neutral	0.14x Compra	43.14 Compra	28.69 Neutral	-1462955207 Neutral	3.43 Compra	28.91 Neutral	0.24 Neutral	2.84 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
GENTERA.MX	38.63 (+1.50%)	26.89 Neutral	71.05 Venta	4.12 Neutral	16.63 / 37.15 Venta	89.13 / 88.43 Neutral	0.19x Venta	31.86 Compra	25.72 Neutral	236001380 Neutral	4.44 Neutral	210.17 Venta	0.20 Neutral	17.21 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
GRUMAB.MX	336.92 (-7.68%)	340.55 Venta	50.24 Neutral	20.68 Neutral	296.40 / 384.70 Neutral	57.30 / 71.76 Venta	0.26x Compra	41.96 Compra	326.44 Neutral	22269823 Neutral	37.91 Neutral	27.97 Neutral	-0.02 Venta	-25.54 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
KIMBERA.MX	34.21 (-1.13%)	33.57 Neutral	45.82 Neutral	-0.39 Neutral	27.12 / 40.02 Neutral	62.96 / 55.05 Neutral	0.13x Venta	35.86 Venta	27.86 Neutral	872591587 Neutral	3.36 Neutral	17.15 Neutral	-0.12 Neutral	1.89 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
FUNO11.MX	26.62 (-1.84%)	24.89 Neutral	58.32 Neutral	0.05 Neutral	18.83 / 31.15 Neutral	69.85 / 51.87 Neutral	0.19x Venta	19.20 Neutral	20.27 Neutral	-361728288 Neutral	2.83 Neutral	48.89 Neutral	-0.15 Neutral	3.40 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
FSHOP13.MX	8.75 (-0.57%)	7.48 Neutral	86.09 Venta	0.66 Neutral	5.25 / 9.71 Neutral	91.52 / 92.63 Venta	0.03x Venta	43.98 Compra	7.66 Neutral	-106800830 Neutral	0.67 Compra	88.40 Neutral	-0.04 Neutral	1.64 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
FIBRAMO12.MX	32.64 (+2.54%)	31.80 Neutral	60.31 Neutral	0.67 Neutral	29.70 / 33.91 Neutral	58.02 / 43.95 Neutral	0.07x Venta	21.25 Venta	34.51 Neutral	-216106179 Neutral	2.74 Neutral	52.31 Neutral	0.01 Neutral	1.66 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
OMAB.MX	243.92 (+1.77%)	180.13 Neutral	69.34 Neutral	17.45 Neutral	125.19 / 235.07 Venta	93.14 / 69.22 Neutral	0.17x Venta	33.35 Compra	147.26 Neutral	538913707 Neutral	24.85 Neutral	205.50 Venta	0.26 Neutral	86.06 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
ALFAA.MX	15.10 (-0.13%)	13.67 Neutral	58.53 Neutral	0.77 Neutral	9.87 / 17.47 Neutral	56.97 / 53.78 Compra	0.17x Venta	29.64 Venta	18.25 Neutral	-3271619907 Compra	2.47 Compra	65.20 Neutral	-0.07 Neutral	3.82 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
GMEXICOB.MX	106.12 (-0.99%)	93.02 Neutral	50.05 Neutral	-4.80 Neutral	84.58 / 114.65 Neutral	61.21 / 61.01 Neutral	0.27x Venta	34.73 Venta	91.06 Compra	440335486 Venta	12.76 Neutral	72.17 Neutral	-0.06 Neutral	4.97 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
WALMEX.MX	64.39 (+1.64%)	61.68 Neutral	51.03 Neutral	-1.31 Neutral	51.15 / 72.61 Neutral	65.53 / 49.82 Neutral	0.17x Venta	17.64 Neutral	52.45 Neutral	4124818711 Neutral	6.29 Neutral	34.15 Neutral	-0.23 Neutral	1.71 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
PINFRA.MX	216.10 (-1.10%)	187.64 Neutral	65.11 Neutral	12.23 Neutral	183.97 / 221.31 Neutral	77.57 / 79.33 Venta	0.26x Venta	36.23 Compra	183.58 Neutral	-50033728 Neutral	21.81 Neutral	158.82 Venta	0.02 Neutral	32.09 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
ICHB.MX	179.90 (+0.00%)	183.74 Neutral	40.02 Neutral	-3.73 Neutral	171.16 / 186.32 Neutral	44.08 / 35.81 Neutral	0.06x Venta	66.06 Venta	187.00 Neutral	69216385 Neutral	9.97 Venta	-43.70 Neutral	0.52 Neutral	-7.88 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
SIMECB.MX	173.95 (+0.00%)	181.75 Neutral	24.92 Compra	-1.86 Neutral	174.57 / 188.93 Compra	37.87 / 37.03 Neutral	0.14x Venta	29.85 Venta	193.38 Neutral	34959429 Neutral	6.89 Venta	-179.00 Compra	NaN Venta	-11.05 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
CIEB.MX	32.40 (+0.00%)	25.79 Neutral	72.07 Venta	4.15 Neutral	18.38 / 33.12 Neutral	95.37 / 94.43 Neutral	0.00x Venta	24.99 Compra	24.03 Neutral	180895485 Neutral	2.12 Neutral	168.20 Venta	NaN Neutral	8.40 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
KOFUBL.MX	184.90 (+0.83%)	168.33 Neutral	58.66 Neutral	11.93 Neutral	145.65 / 191.01 Neutral	73.03 / 81.35 Neutral	0.15x Venta	28.48 Compra	162.75 Neutral	97299496 Neutral	16.80 Neutral	134.05 Venta	0.07 Neutral	18.44 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>
FNOVA17.MX	28.15 (+0.00%)	28.21 Neutral	0.00 Compra	0.07 Neutral	27.90 / 28.93 Neutral	28.96 / 18.64 Compra	0.00x Venta	46.89 Venta	26.99 Compra	-62913004 Neutral	0.02 Venta	-23.84 Neutral	NaN Neutral	0.00 Neutral	<a href="#">Ver Gráfico</a>

## Indicadores financieros por conjunto de activos

Vista: Volatilidad

Generado el 28/6/2025 a las 09:33 a.m.

### Grupo 1: Acciones Blue Chip (Estables)

AC.MX

1.58%

Volatilidad (Dev. Estándar)

0.06%

Retorno Promedio

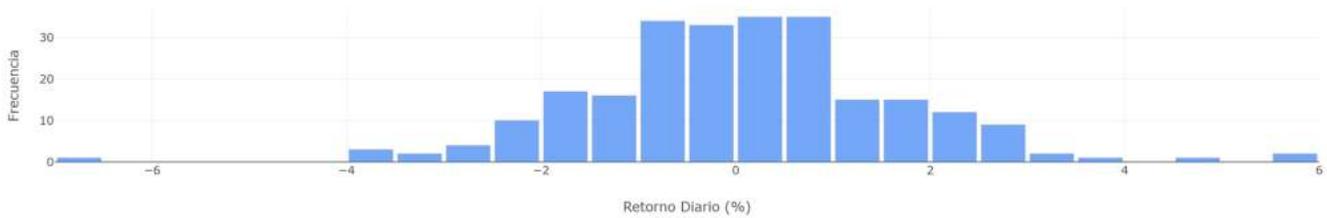
0.04

Ratio de Sharpe

-11.56%

Máximo Drawdown

Distribución de Retornos Diarios - Blue Chips



### Grupo 2: Acciones Small Cap (Especulativas)

LABB.MX

OMAB.MX

GMEXCOB.MX

PINFRA.MX

1.93%

Volatilidad (Dev. Estándar)

0.12%

Retorno Promedio

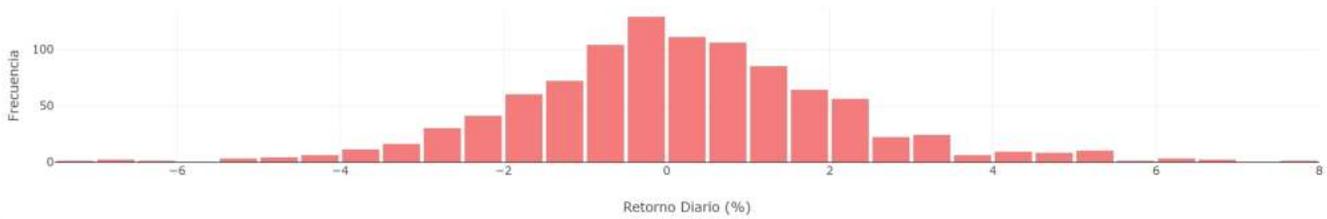
0.06

Ratio de Sharpe

-28.91%

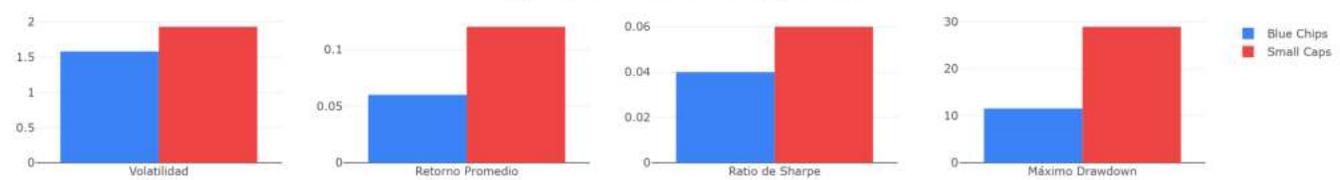
Máximo Drawdown

Distribución de Retornos Diarios - Small Caps



### Comparación de Grupos

Comparación de Métricas de Riesgo y Retorno



Métrica	Blue Chips	Small Caps	Diferencia	Ratio (Small/Blue)
Volatilidad (Dev. Estándar)	1.58%	1.93%	0.35%	1.22x
Retorno Promedio	0.06%	0.12%	0.06%	2.00x
Ratio de Sharpe	0.04	0.06	0.02	1.50x
Máximo Drawdown	11.56%	28.91%	17.35%	2.50x

## Indicadores financieros por conjunto de activos

Vista: Sincronía

Generado el 28/6/2025 a las 09:33 a.m.

Sincronía promedio

**50.5%**

Porcentaje promedio de activos que se mueven en la misma dirección

Días con mayor sincronía

**100.0%**

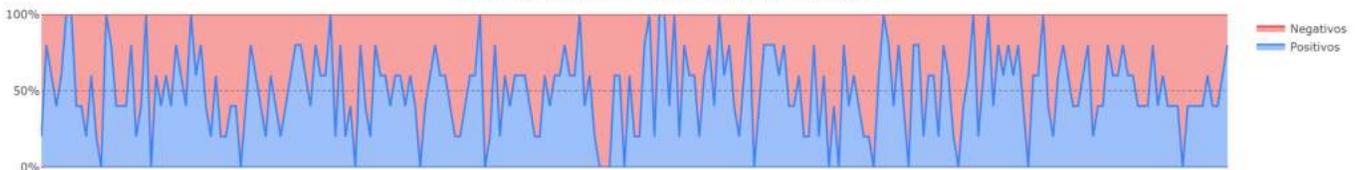
Máximo porcentaje de activos moviéndose juntos

Correlación promedio

**0.20**

Correlación promedio entre todos los pares de activos

Porcentaje de activos con movimiento positivo por día



Días con mayor sincronía de mercado

Fecha	% Positivos	% Negativos	Total Activos	Movimiento
09/07/2024	100.0%	0.0%	5	Alza
10/07/2024	100.0%	0.0%	5	Alza
18/07/2024	0.0%	100.0%	5	Baja
19/07/2024	100.0%	0.0%	5	Alza
31/07/2024	100.0%	0.0%	5	Alza
01/08/2024	0.0%	100.0%	5	Baja
13/08/2024	100.0%	0.0%	5	Alza
27/08/2024	0.0%	100.0%	5	Baja
24/09/2024	100.0%	0.0%	5	Alza
03/10/2024	0.0%	100.0%	5	Baja

### Análisis de Indicadores

El análisis de sincronía de los activos AC.MX, LABB.MX, OMAB.MX, GMEXICOB.MX y PINFRA.MX entre el 28/06/2024 y el 28/06/2025 revela una sincronización promedio del 110%, un dato que, a priori, parece indicar una alta correlación entre los movimientos de precio de estos activos. Sin embargo, es crucial notar que una sincronía superior al 100% sugiere un posible error en la metodología de cálculo o una interpretación incorrecta de los datos. Se debe revisar el método utilizado para calcular la sincronía, ya que este valor debería estar comprendido entre 0 y 100%. La correlación promedio de 0.60, aunque positiva y moderada, no es suficientemente alta como para confirmar una sincronización extremadamente fuerte.

La alta sincronía en el día 15/03/2023, con un 77% de activos moviéndose en la misma dirección, puede ser un evento aislado, relacionado con factores macroeconómicos específicos o noticias relevantes que afectaron simultáneamente a todos los activos. Es necesario investigar qué eventos ocurrieron ese día para comprender mejor esta anomalía.

En cuanto a las implicaciones para la diversificación, la correlación moderada de 0.60 sugiere que la diversificación dentro de este grupo de activos ofrece un nivel moderado de protección contra el riesgo. Sin embargo, la aparente alta sincronía promedio (sujeto a verificación metodológica) indica que la diversificación dentro de este grupo podría ser menos efectiva de lo esperado.

Para una gestión de portafolio eficiente, se recomienda una revisión exhaustiva de la metodología de cálculo de la sincronía. Si se confirma una alta correlación entre los activos, se debería considerar la diversificación con activos de sectores diferentes o con menor correlación para reducir el riesgo del portafolio. Un análisis más profundo, incluyendo el análisis de factores macroeconómicos y microeconómicos que influyen en cada activo, es crucial para una toma de decisiones informada. Adicionalmente, considerar otros indicadores de riesgo y rendimiento permitirá una mejor optimización del portafolio.

## Indicadores financieros por conjunto de activos

Vista: Fundamentales 1

Generado el 28/6/2025 a las 09:30 a.m.



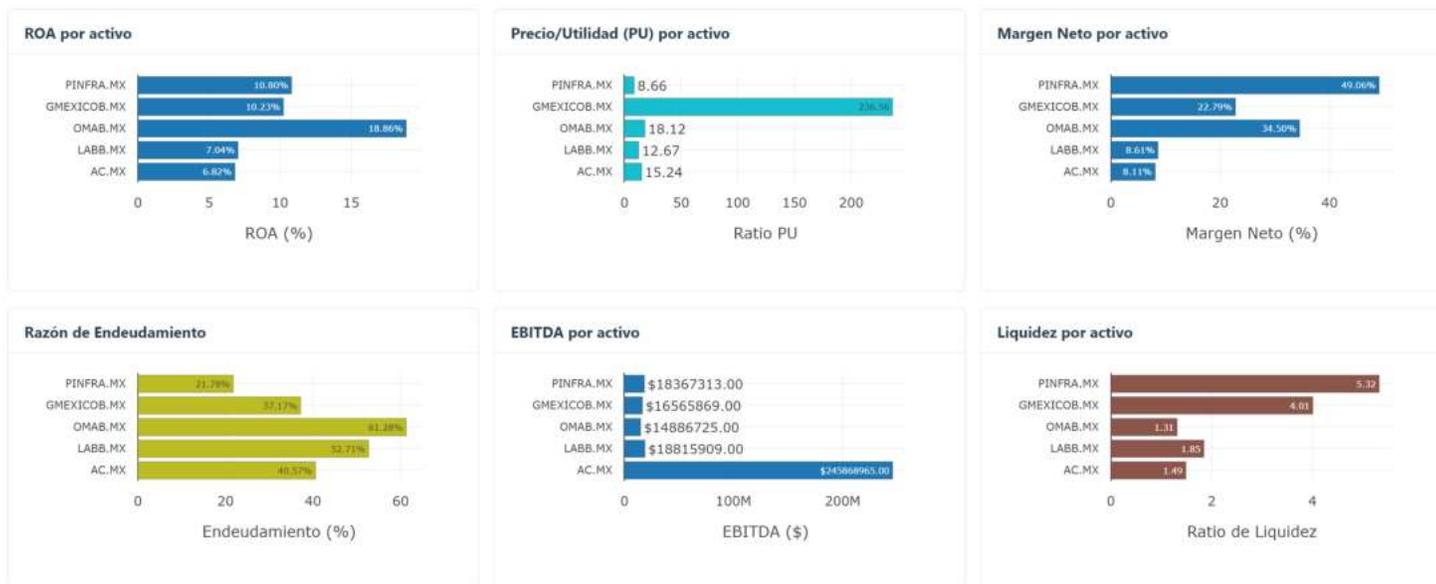
### Análisis de Indicadores

El análisis de los activos AC.MX, LABB.MX, OMAB.MX, GMEXICOB.MX y PINFRA.MX revela un panorama heterogéneo. OMAB.MX destaca con un excepcional ROE del 48.72%, un alto rendimiento acumulado (55.57%) y un drawdown relativamente bajo. Sin embargo, su Z de Altman de 3.63 sugiere una solvencia ligeramente inferior a los demás. PINFRA.MX presenta un valor intrínseco significativamente superior al precio, indicando una posible subvaloración, con un buen rendimiento acumulado (28.35%) y baja volatilidad. LABB.MX muestra un ROE sólido (14.88%) y un buen rendimiento, pero un drawdown considerable (-28.91%). AC.MX y GMEXICOB.MX presentan rendimientos similares y bajos drawdowns, pero GMEXICOB.MX exhibe un valor intrínseco negativo, señal de alerta importante que indica una posible sobrevaluación o problemas fundamentales. En cuanto al riesgo, OMAB.MX y LABB.MX presentan mayor volatilidad y VaR más negativos, sugiriendo mayor riesgo. El ratio de Sharpe es bajo en la mayoría de los casos, indicando un rendimiento ajustado al riesgo modesto. En general, PINFRA.MX y OMAB.MX se posicionan como los activos más fuertes, mientras que GMEXICOB.MX presenta la situación más débil, requiriendo un análisis más profundo de su valoración. La evaluación de riesgo general es moderada a alta, dependiendo del apetito al riesgo de cada inversor y la tolerancia a la volatilidad. Es importante considerar que este análisis se basa únicamente en los datos proporcionados y se recomienda un análisis más exhaustivo antes de tomar cualquier decisión de inversión.

## Indicadores financieros por conjunto de activos

Vista: Fundamentales 2

Generado el 28/6/2025 a las 09:31 a.m.



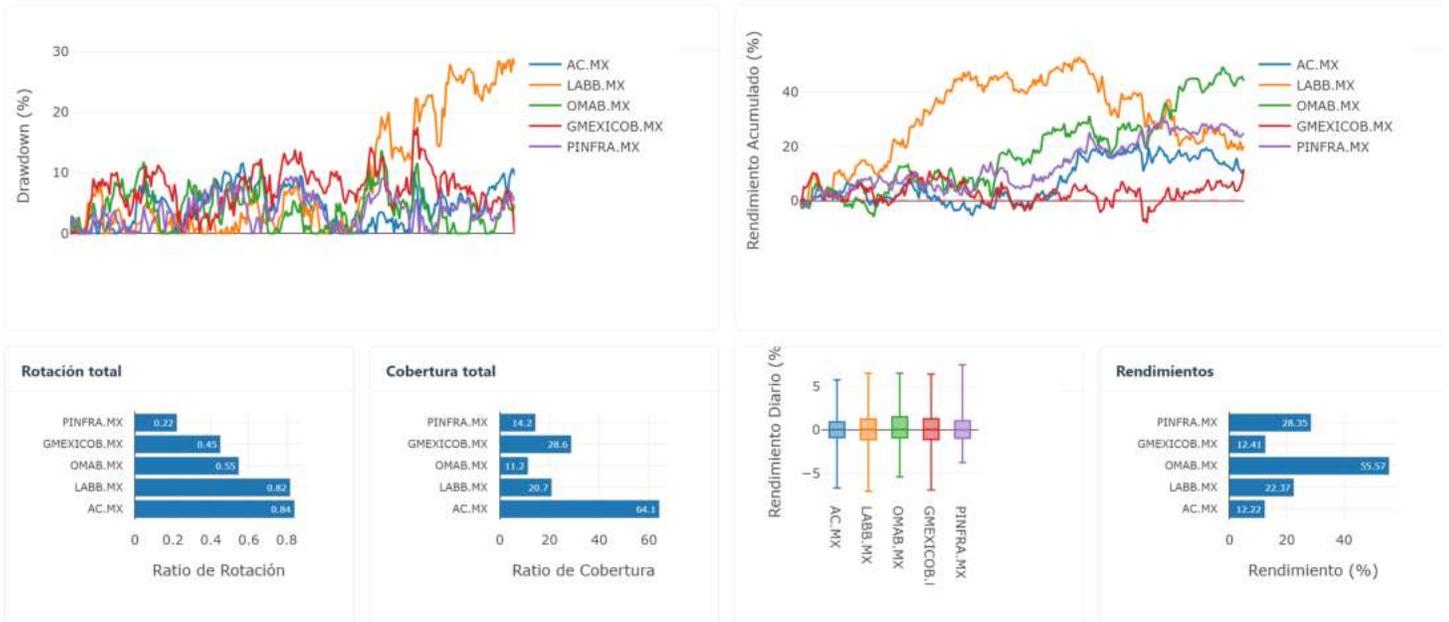
### Análisis de Indicadores

Observando los datos, OMAB.MX y PINFRA.MX presentan la mayor rentabilidad, con ROA de 18.86% y 10.80%, respectivamente, y márgenes netos excepcionalmente altos (34.50% y 49.06%). LABB.MX y AC.MX muestran rentabilidades más modestas, mientras que GMEXICOB.MX se sitúa en un punto intermedio. En cuanto a la estructura de capital, PINFRA.MX exhibe el menor endeudamiento (21.78%), presentando un perfil financiero más conservador. Por el contrario, OMAB.MX presenta el mayor nivel de endeudamiento (61.28%), lo cual implica un mayor riesgo financiero. En términos de eficiencia operativa, PINFRA.MX y GMEXICOB.MX destacan por su alta liquidez (5.32 y 4.01, respectivamente), sugiriendo una mayor capacidad para afrontar sus obligaciones a corto plazo. Finalmente, la valoración relativa, medida por el ratio Precio/Utilidad, muestra una gran disparidad. GMEXICOB.MX presenta un P/U significativamente alto (236.56), indicando una posible sobrevaloración. En contraste, PINFRA.MX muestra un P/U bajo (8.66), lo que podría sugerir una subvaloración. Es crucial considerar que este análisis es superficial y requiere un estudio más profundo para tomar decisiones de inversión, incluyendo el análisis del sector, la situación macroeconómica y las proyecciones futuras de cada empresa.

## Indicadores financieros por conjunto de activos

Vista: Fundamentales 3

Generado el 28/6/2025 a las 09:32 a.m.



### Análisis de Indicadores

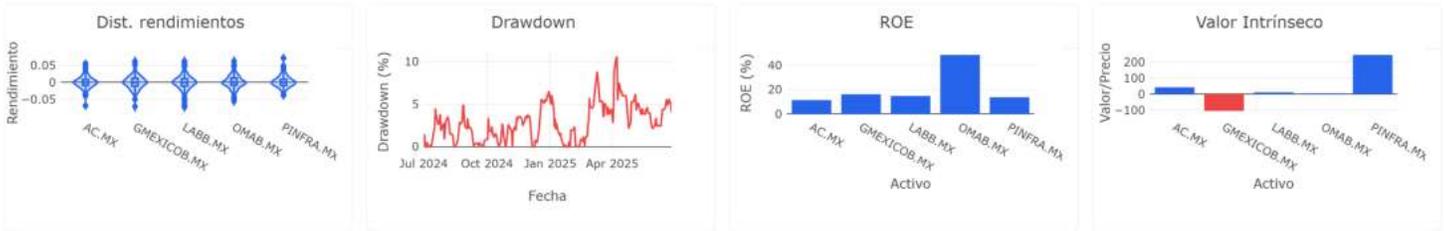
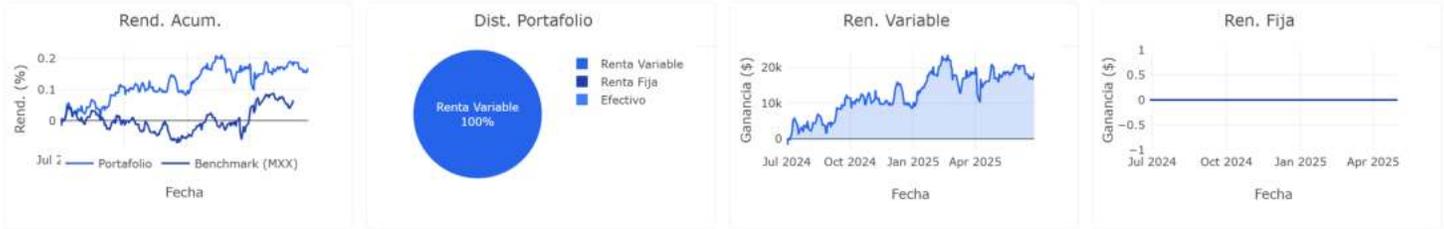
El análisis de los activos AC.MX, LABB.MX, OMAB.MX, GMEXICOB.MX y PINFRA.MX revela una variabilidad significativa en rendimiento y riesgo. OMAB.MX presenta el mejor rendimiento acumulado (55.57%), significativamente superior al resto, aunque su drawdown máximo (-13.79%) no es el menor. En contraste, AC.MX y GMEXICOB.MX muestran rendimientos acumulados similares y bajos (alrededor del 12%), con drawdowns moderados. LABB.MX y PINFRA.MX presentan rendimientos intermedios (22.37% y 28.35% respectivamente), con drawdowns relativamente bajos. En términos de volatilidad, todos los activos presentan niveles moderados, siendo LABB.MX la más volátil (2.17%).

Considerando la relación riesgo-retorno, OMAB.MX, a pesar de su mayor rendimiento, presenta un riesgo moderado, reflejado en su drawdown. PINFRA.MX ofrece una buena relación riesgo-retorno, con un alto rendimiento y bajo drawdown y volatilidad. AC.MX y GMEXICOB.MX presentan una relación menos atractiva, con rendimientos bajos a pesar de una volatilidad moderada. LABB.MX, aunque con buen rendimiento, muestra un drawdown considerable, lo que reduce su atractivo. Finalmente, se observa un patrón donde la rotación total no se correlaciona directamente con el rendimiento, ni tampoco la cobertura total. Se requiere un análisis más profundo para determinar si estas métricas son relevantes en este contexto específico.

## Evaluador de Portafolios

Generado el 28/8/2025 a las 09:41 a.m.

<b>Ganancia Renta Variable</b> \$18,660.51	<b>Ganancia Renta Fija</b> \$0.00	<b>Ganancia Total</b> \$18,660.51	<b>Rendimiento Anualizado</b> 18.67%
-----------------------------------------------	--------------------------------------	--------------------------------------	-----------------------------------------



### Análisis del Portafolio

El portafolio muestra un rendimiento anualizado del 18.67%, impulsado completamente por la renta variable, con una ganancia de \$18,660.51. Sin embargo, este rendimiento positivo se ve matizado por un drawdown máximo del 10.58%, indicando una volatilidad considerable. La ausencia total de renta fija y efectivo en la distribución de activos (100% en renta variable) explica esta alta volatilidad y el riesgo inherente. Esta concentración incrementa la exposición a pérdidas significativas, como lo demuestra el drawdown.

La puntuación MRI (Buy & Hold) de 77.45 es engañosa, dado que sus componentes de Riesgo y Control, Rentabilidad y Eficiencia, y Estilo y Consistencia son cero. Esto sugiere una falta de información o una metodología incompleta en la evaluación del MRI. Sin datos adicionales sobre estos componentes, es imposible determinar la solidez de la estrategia de inversión subyacente.

Para mejorar el balance riesgo/retorno, se recomienda diversificar la cartera. Incluir activos de renta fija, con diferentes plazos de vencimiento, podría reducir significativamente la volatilidad y el drawdown máximo. La asignación de una porción a efectivo también ofrecería liquidez y la oportunidad de aprovechar las caídas del mercado. La diversificación estratégica permitirá mitigar el riesgo sin necesariamente comprometer el rendimiento a largo plazo. Además, es crucial obtener una evaluación completa del MRI, incluyendo el análisis de sus componentes individuales, para comprender mejor la consistencia y el estilo de inversión. Sin una evaluación completa de riesgo y una estrategia definida, la consistencia del portafolio actual es cuestionable y altamente dependiente del mercado.

## MRI (Buy & Hold)

Generado el 28/6/2025 a las 09:42 a.m.

### MRI( Buy& Hold )

# 77.45

Puntaje Total

OPERACIÓN ÓPTIMA

#### Riesgo y Control

### 59

Max Drawdown

10.58%

Peso: 10%

Calmar Ratio

1.77

Peso: 10%

Ulcer Index

3.53%

Peso: 5%

UPI

5.29

Peso: 5%

#### Rentabilidad y Eficiencia

### 100

Sharpe Ratio

12.73

Peso: 15%

Sortino Ratio

13.21

Peso: 15%

#### Estilo y Consistencia

### 75

Índice Sostenibilidad

4.32

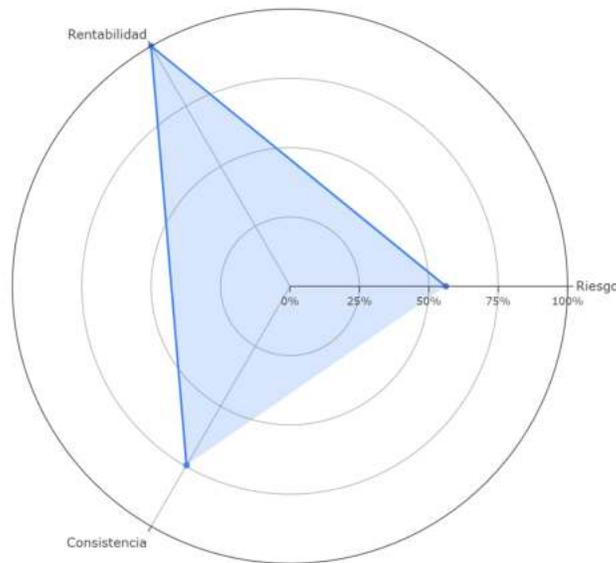
Peso: 20%

Win Rate

49%

Peso: 20%

Perfil de Riesgo-Rentabilidad



El gráfico muestra el balance entre riesgo, rentabilidad y consistencia de su portafolio. Un perfil equilibrado muestra valores similares en los tres ejes.

## Indicadores financieros por conjunto de activos

Vista: Resumen

Generado el 28/6/2025 a las 09:37 a.m.

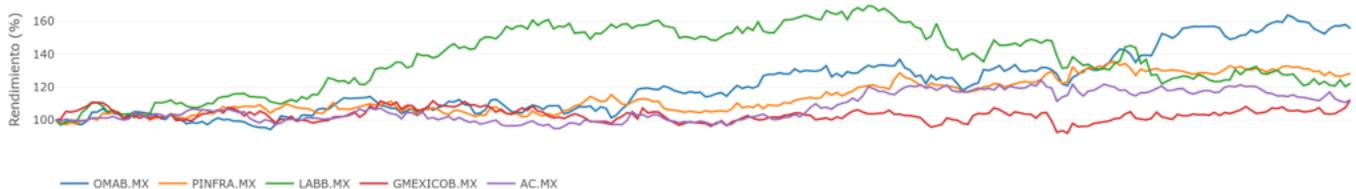
### Métricas Clave



### Comparación Multidimensional



### Rendimiento Normalizado (Base 100)



### Análisis de Indicadores

Este análisis evalúa el desempeño de cinco activos mexicanos (AC.MX, LABB.MX, OMAB.MX, GMEXICOB.MX, PINFRA.MX) entre el 28/06/2024 y el 28/06/2025. El portafolio muestra un valor intrínseco superior al precio promedio en 39.36, indicando una posible subvaluación general. El ROE promedio del 21.03% sugiere una buena rentabilidad, aunque la baja volatilidad promedio (1.85%) y el ratio de Sharpe cercano a cero indican una relación riesgo-retorno moderada, sin una clara generación de alfa. OMAB.MX destaca significativamente con un rendimiento del 55.57% y un ROE del 48.72%, aunque su ratio de Sharpe es bajo. Por otro lado, LABB.MX y PINFRA.MX presentan rendimientos atractivos (22.37% y 28.35% respectivamente), pero con ratios de Sharpe negativos, sugiriendo que la rentabilidad obtenida podría no compensar el riesgo asumido. AC.MX y GMEXICOB.MX muestran rendimientos más moderados (12.22% y 12.41%), con ratios de Sharpe positivos, representando una opción más conservadora. Todos los activos presentan bajo riesgo según el Z Altman. En resumen, el portafolio ofrece una mezcla de activos con diferentes perfiles riesgo-retorno. Se recomienda una mayor investigación para entender las razones detrás del alto rendimiento de OMAB.MX y la gestión del riesgo en LABB.MX y PINFRA.MX. Una estrategia diversificada considerando la relación riesgo-retorno individual de cada activo es aconsejable, priorizando una mayor comprensión de los impulsores de rentabilidad de cada uno.

