

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	ALFA	A	ALTA	4,116,095	44,001,055.55	8.45
1	WALMEX	*	ALTA	628,712	39,143,609.12	7.52
1	FEMSA	UBD	ALTA	180,332	35,494,747.56	6.82
1	ALSEA	*	ALTA	540,849	34,397,996.40	6.61
1	GMEXICO	B	ALTA	326,194	32,100,751.54	6.16
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,536,061	29,697,274.31	5.70
1	GFNORTE	O	ALTA	182,763	26,054,693.28	5.00
1	PINFRA	*	ALTA	142,252	24,077,573.52	4.62
1	ASUR	B	ALTA	42,433	23,372,096.40	4.49
1	ORBITA	*	ALTA	907,512	23,168,781.36	4.45
1	GMXT	*	MEDIA	380,926	13,964,747.16	2.68
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	104,855	13,750,684.70	2.64
1	GCC	*	ALTA	69,742	11,955,871.06	2.30
1	BIMBO	A	ALTA	178,314	11,520,867.54	2.21
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				395,158	14,752,223.14	2.83
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	QVGMEX	18	BAJA	392,412	10,646,137.56	2.04
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	EWZ	*	ALTA	53,895	26,934,664.69	5.17
1ISP	PSQ	*	ALTA	27,670	20,492,155.74	3.93
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					435,525,930.63	83.63
REPORTO						
LF	BONDESF	270930	mxAAA	113,371	11,279,863.73	2.17
TOTAL REPORTO					11,279,863.73	2.17
PRESTAMO DE VALORES						
1	AMX	B	ALTA	1,700,000	26,469,000.00	5.08
1	WALMEX	*	ALTA	200,000	12,452,000.00	2.39
OTROS VALORES					522,569	6.73
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					520,786,692.32	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					38,921,000.00	7.47

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.165%

Limite de VaR
3.500%

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