

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 18 JULIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	ALFA	A	ALTA	3,921,530	42,823,107.60	8.04
1	ORBIA	*	ALTA	1,339,690	33,786,981.80	6.34
1	ALSEA	*	ALTA	554,280	33,572,739.60	6.30
1	GMEXICO	B	ALTA	325,607	33,075,159.06	6.21
1	FEMSA	UBD	ALTA	154,633	32,171,395.65	6.04
1	WALMEX	*	ALTA	506,408	32,070,818.64	6.02
1	AMX	B	ALTA	1,736,266	27,137,837.58	5.09
1	ASUR	B	ALTA	42,433	23,536,736.44	4.42
1	BIMBO	A	ALTA	306,464	19,429,817.60	3.65
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,669,051	18,977,109.87	3.56
1	PINFRA	*	ALTA	86,175	14,609,247.75	2.74
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	104,855	14,528,708.80	2.73
1	GCC	*	ALTA	92,557	14,366,697.54	2.70
1	GMXT	*	MEDIA	380,926	13,694,289.70	2.57
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				113,149	13,635,833.35	2.56
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
OTROS TIPO DE VALOR 1B - TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES				326,298	11,995,262.03	2.25
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	EWZ	*	ALTA	33,667	16,996,606.65	3.19
OTROS TIPO DE VALOR 1ISP - TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				16,366	10,668,017.63	2.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					407,076,367.29	76.39
REPORTO						
LF	BONDESF	280127	mxAAA	653,759	64,972,196.36	12.19
TOTAL REPORTO					64,972,196.36	12.19
PRESTAMO DE VALORES						
1	GFNORTE	O	ALTA	97,051	14,301,435.36	2.68
1	PINFRA	*	ALTA	68,500	11,612,805.00	2.18
OTROS VALORES						
				841,555	34,930,364.57	6.55
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					532,893,168.58	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					25,914,240.36	4.86

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.229%

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