

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 19 SEPTIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	ALSEA	*	ALTA	854,113	45,438,811.60	8.67
1	WALMEX	*	ALTA	679,392	41,605,966.08	7.94
1	FEMSA	UBD	ALTA	205,377	40,553,742.42	7.74
1	GCC	*	ALTA	256,652	38,533,731.28	7.36
1	GFNORTE	O	ALTA	225,209	31,430,168.04	6.00
1	GMEXICO	B	ALTA	278,254	29,581,182.74	5.65
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	238,499	27,670,653.98	5.28
1	ASUR	B	ALTA	45,244	25,290,943.56	4.83
1	ORBIA	*	ALTA	1,168,921	22,747,202.66	4.34
1	ALFA	A	ALTA	1,589,681	21,842,216.94	4.17
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,680,960	20,726,236.80	3.96
1	AMX	B	ALTA	943,747	15,250,951.52	2.91
1	NEMAK	A	MEDIA	7,224,128	14,881,703.68	2.84
1	GMXT	*	MEDIA	380,926	12,707,691.36	2.43
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				244,785	21,048,131.20	4.02
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	PSQ	*	ALTA	19,602	15,293,208.60	2.92
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					424,602,542.46	81.05
REPORTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	6,314,106	54,564,621.35	10.42
TOTAL REPORTO					54,564,621.35	10.42
PRESTAMO DE VALORES						
1	AMX	B	ALTA	1,400,000	22,624,000.00	4.32
OTROS VALORES					536,815	4.21
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					523,870,712.16	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					22,624,000.00	4.32

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.139%

Límite 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