

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	FEMSA	UBD	ALTA	205,377	39,890,374.71	7.63
1	WALMEX	*	ALTA	679,392	37,380,147.84	7.15
1	ASUR	B	ALTA	58,678	31,402,705.26	6.00
1	GFNORTE	O	ALTA	225,209	31,378,369.97	6.00
1	ALSEA	*	ALTA	647,607	31,331,226.66	5.99
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	238,499	25,185,494.40	4.82
1	AMX	B	ALTA	1,561,473	24,686,888.13	4.72
1	ORBIA	*	ALTA	1,246,284	22,881,774.24	4.38
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,620,588	17,080,997.52	3.27
1	GMEXICO	B	ALTA	162,443	17,006,157.67	3.25
1	ALFA	A	ALTA	1,092,215	15,837,117.50	3.03
1	GCC	*	ALTA	93,561	15,310,322.04	2.93
1	NEMAK	A	MEDIA	7,224,128	15,242,910.08	2.91
1	PINFRA	*	ALTA	69,722	12,168,580.66	2.33
1	GMXT	*	MEDIA	380,926	11,488,728.16	2.20
1	PINFRA	L	MEDIA	83,956	11,292,921.56	2.16
				159,918	11,676,267.21	2.23
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	SIL	*	ALTA	23,449	18,140,648.07	3.47
1ISP	EEM	*	ALTA	14,593	12,980,247.38	2.48
OTROS TIPO DE VALOR 1ISP - TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
				17,467	17,819,625.61	3.41
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					420,181,504.67	80.34
REPORTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	6,571,355	58,500,410.23	11.19
TOTAL REPORTO					58,500,410.23	11.19
PRESTAMO DE VALORES						
1	AMX	B	ALTA	782,274	12,367,751.94	2.36
OTROS VALORES					601,386	6.11
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					522,981,511.38	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					12,367,751.94	2.36

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.148%

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