

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				116,675	27,160,606.00	4.73
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	724,158	46,288,179.36	8.06
1	PINFRA	L	MEDIA	286,956	35,008,632.00	6.10
1	GFNORTE	O	ALTA	198,873	33,718,917.15	5.87
1	ALSEA	*	ALTA	392,890	28,193,786.40	4.91
1	PINFRA	*	ALTA	152,129	26,179,879.61	4.56
1	FEMSA	UBD	ALTA	127,410	25,534,238.10	4.45
1	ALFA	A	ALTA	1,731,909	21,822,053.40	3.80
1	ASUR	B	ALTA	33,292	19,590,677.40	3.41
1	GMEXICO	B	ALTA	162,251	17,174,268.35	2.99
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	104,855	14,331,581.40	2.50
1	GMXT	*	MEDIA	380,926	13,926,654.56	2.43
1	TLEVISA	CPO	ALTA	1,254,658	12,709,685.54	2.21
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,739,704	51,346,598.93	8.94
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	QVGMEX	18	BAJA	585,042	17,030,572.62	2.97
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	EWZ	*	ALTA	44,291	23,538,212.96	4.10
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					413,554,543.78	72.03
REPORTO						
LF	BONDEF	250424	mxAAA	512,695	51,283,744.86	8.93
TOTAL REPORTO					51,283,744.86	8.93
PRESTAMO DE VALORES						
1	AMX	B	ALTA	1,700,000	27,727,000.00	4.83
1	ORBIA	*	ALTA	900,000	25,326,000.00	4.41
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,300,000	17,641,000.00	3.07
OTROS VALORES					538,965	6.73
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					574,169,902.94	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					70,694,000.00	12.31

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.142%

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