

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 25 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)						
1ASP	ITUB	N	ALTA	105,145	11,058,635.47	2.09
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	ORBIA	*	ALTA	1,116,437	35,837,627.70	6.77
1	PINFRA	L	MEDIA	286,956	33,810,472.76	6.39
1	WALMEX	*	ALTA	415,319	28,058,951.64	5.30
1	FEMSA	UBD	ALTA	127,410	25,253,936.10	4.77
1	ALFA	A	ALTA	1,731,909	22,168,435.20	4.19
1	GMEXICO	B	ALTA	214,222	22,060,581.56	4.17
1	GFNORTE	O	ALTA	122,136	21,384,792.24	4.04
1	PINFRA	*	ALTA	114,983	19,990,944.38	3.78
1	ASUR	B	ALTA	33,292	19,865,336.40	3.75
1	AC	*	ALTA	99,604	16,515,339.24	3.12
1	ALSEA	*	ALTA	212,096	15,752,369.92	2.98
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	104,855	14,547,582.70	2.75
1	GMXT	*	MEDIA	380,926	14,181,874.98	2.68
1	TLEVISA	CPO	ALTA	1,254,658	12,722,232.12	2.40
				1,239,746	27,286,594.76	5.16
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	QVGMEX	18	BAJA	586,245	17,006,967.45	3.21
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	EWZ	*	ALTA	54,434	28,869,127.20	5.46
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					386,371,801.82	73.02
REPORTO						
LF	BONDESF	261203	mxAAA	265,215	26,421,371.51	4.99
TOTAL REPORTO					26,421,371.51	4.99
PRESTAMO DE VALORES						
1	AMX	B	ALTA	1,700,000	26,758,000.00	5.06
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,300,000	18,330,000.00	3.46
OTROS VALORES					869,377	13.47
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					529,152,479.71	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					45,088,000.00	8.52

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.141%

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