

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJO	O	ALTA	259,698	10,881,346.20	2.10
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	FEMSA	UBD	ALTA	205,377	38,261,735.10	7.39
1	WALMEX	*	ALTA	679,392	37,393,735.68	7.22
1	AMX	B	ALTA	2,343,747	36,140,578.74	6.98
1	GFNORTE	O	ALTA	225,209	32,380,550.02	6.25
1	ALSEA	*	ALTA	654,297	30,974,419.98	5.98
1	ASUR	B	ALTA	54,829	29,488,681.07	5.69
1	GMEXICO	B	ALTA	265,692	27,198,890.04	5.25
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	238,499	25,268,969.05	4.88
1	ORBITA	*	ALTA	1,278,044	22,902,548.48	4.42
1	ALFA	A	ALTA	1,092,215	16,940,254.65	3.27
1	NEMAK	A	MEDIA	7,224,128	12,642,224.00	2.44
1	GMXT	*	MEDIA	380,926	12,239,152.38	2.36
1	PINFRA	*	ALTA	69,722	12,139,994.64	2.34
1	GCC	*	ALTA	65,405	11,727,116.50	2.26
1	PINFRA	L	MEDIA	83,956	11,208,126.00	2.16
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				558,922	17,998,815.73	3.48
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	SIL	*	ALTA	23,449	16,874,170.13	3.26
1ISP	EEM	*	ALTA	14,593	12,802,453.42	2.47
1ISP	EWZ	*	ALTA	22,690	12,703,663.61	2.45
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					428,167,425.42	82.69
REPORTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	4,687,192	41,901,085.17	8.09
TOTAL REPORTO					41,901,085.17	8.09
OTROS VALORES				2,399,160	47,751,274.22	9.22
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					517,819,784.81	100.00

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA
	RVDIS
	VaR Promedio
	1.145%
	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 período 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

Lic. Julio Andres Maza Casas