

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 15 MAYO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	580,619	57,156,134.36	9.53
1	ASUR	B	ALTA	62,311	41,937,172.33	6.99
1	GMEXICO	B	ALTA	396,942	41,567,766.24	6.93
1	ORBIA	*	ALTA	2,362,763	32,109,949.17	5.36
1	FEMSA	UBD	ALTA	119,248	23,847,215.04	3.98
1	WALMEX	*	ALTA	274,694	17,552,946.60	2.93
1	PINFRA	L	MEDIA	83,956	14,440,432.00	2.41
1	PINFRA	*	ALTA	66,125	14,108,430.00	2.35
1	CTALPEK	A	MEDIA	4,236,410	13,302,327.40	2.22
1	GMXT	*	MEDIA	380,926	13,016,241.42	2.17
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				979,629	35,817,122.08	5.97
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	QVGMEX	18	BAJA	894,566	28,393,524.84	4.74
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	PSQ	*	ALTA	25,510	17,890,690.75	2.98
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					351,139,952.23	58.57
REPORTO						
LF	BONDEF	270225	mxAAA	615,540	61,673,648.87	10.29
TOTAL REPORTO					61,673,648.87	10.29
PRESTAMO DE VALORES						
1	GFNORTE	O	ALTA	200,000	34,876,000.00	5.82
1	AMX	B	ALTA	2,000,000	33,800,000.00	5.64
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,000,000	26,860,000.00	4.48
1	ALSEA	*	ALTA	474,727	22,644,477.90	3.78
OTROS VALORES				1,573,353	68,548,454.86	11.43
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					599,542,533.86	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					118,180,477.90	19.71

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.276%

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