

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 2021

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|--|---------|---------|-----------------------|---------------|-----------------------|--------------------------|
| DISPONIBILIDADES | | | | | | |
| DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA | | | | | | |
| AIM | GBM | 0777794 | | 2,832,000 | 2,832,315.00 | 0.45 |
| BI | CETES | 210701 | mxAAA | 133,570 | 1,331,173.98 | 0.21 |
| EAIM | GBM-INT | 0004721 | | 5,126 | 5,126.00 | 0.00 |
| TOTAL DISPONIBILIDADES | | | | | 4,168,614.98 | 0.67 |
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | | |
| INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | | |
| EMPRESAS MATERIALES | | | | | | |
| 1 | GMEXICO | B | ALTA | 215,663 | 20,949,503.82 | 3.35 |
| 1 | PE&OLES | * | ALTA | 35,868 | 10,853,298.12 | 1.74 |
| EMPRESAS INDUSTRIALES | | | | | | |
| 1 | ALFA | A | ALTA | 1,500,256 | 20,973,578.88 | 3.35 |
| 1 | ASUR | B | ALTA | 22,931 | 8,330,373.68 | 1.33 |
| 1 | GMXT | * | ALTA | 361,107 | 12,032,085.24 | 1.92 |
| 1 | OMA | B | ALTA | 97,128 | 12,438,211.68 | 1.99 |
| 1 | ORBIA | * | ALTA | 429,548 | 24,230,802.68 | 3.88 |
| 1 | PINFRA | * | ALTA | 115,061 | 18,374,091.09 | 2.94 |
| 1 | PINFRA | L | MEDIA | 286,795 | 30,113,475.00 | 4.82 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO | | | | | | |
| 1 | LIVEPOL | C-1 | ALTA | 151,253 | 12,738,527.66 | 2.04 |
| 1 | NMK | A | ALTA | 4,140,909 | 12,961,045.17 | 2.07 |
| EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE | | | | | | |
| 1 | AC | * | ALTA | 162,567 | 18,376,573.68 | 2.94 |
| 1 | BACHOCO | B | MEDIA | 252,427 | 19,315,714.04 | 3.09 |
| 1 | CHDRAUI | B | MEDIA | 709,004 | 22,354,896.12 | 3.58 |
| 1 | FEMSA | UBD | ALTA | 116,713 | 19,536,589.07 | 3.12 |
| 1 | KOF | UBL | ALTA | 68,059 | 6,749,411.03 | 1.08 |
| 1 | WALMEX | * | ALTA | 101,479 | 6,636,726.60 | 1.06 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS | | | | | | |
| 1 | GFNORTE | O | ALTA | 42,148 | 5,794,507.04 | 0.93 |
| 1B | QVGMEX | 18 | BAJA | 29,630 | 682,675.20 | 0.11 |
| 1ISP | DOG | * | ALTA | 46,925 | 31,914,042.09 | 5.10 |
| 1ISP | EEM | * | ALTA | 17,900 | 19,588,949.40 | 3.13 |
| 1ISP | GDX | * | ALTA | 29,273 | 23,014,789.44 | 3.68 |
| 1ISP | GDXJ | * | NA | 8,825 | 9,629,518.73 | 1.54 |
| 1ISP | PSQ | * | NA | 60,005 | 15,809,328.03 | 2.53 |
| 1ISP | TLT | * | ALTA | 3,312 | 9,144,818.11 | 1.46 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES | | | | | | |
| 1 | AMX | L | ALTA | 301,679 | 4,700,158.82 | 0.75 |
| TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | 397,243,690.42 | 63.53 |
| INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | | |
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | | |
| BI | CETES | 210701 | mxAAA | 572,406 | 5,704,664.02 | 0.91 |
| TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | 5,704,664.02 | 0.91 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 402,948,354.44 | 64.44 |
| OPERACIONES DE REPORTE | | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | | |
| IM | BPAG28 | 231109 | mxAAA | 1,460,405 | 145,207,880.08 | 23.22 |
| TOTAL OPERACIONES DE REPORTE | | | | | 145,207,880.08 | 23.22 |
| OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES | | | | | | |
| PRESTAMISTA | | | | | | |
| 1 | AC | * | ALTA | 8,058 | 910,876.32 | 0.15 |
| 1 | AC | * | ALTA | 5,000 | 565,200.00 | 0.09 |
| 1 | AMX | L | ALTA | 1,700,000 | 26,486,000.00 | 4.24 |
| 1 | AMX | L | ALTA | 1,093,844 | 17,042,089.52 | 2.73 |
| 1 | CHDRAUI | B | MEDIA | 3,827 | 120,665.31 | 0.02 |
| 1 | GFNORTE | O | ALTA | 70,000 | 9,623,600.00 | 1.54 |
| 1 | GFNORTE | O | ALTA | 30,324 | 4,168,943.52 | 0.67 |
| 1 | GMXT | * | ALTA | 3,120 | 103,958.40 | 0.02 |
| 1 | KOF | UBL | ALTA | 22,482 | 2,229,539.94 | 0.36 |
| 1 | PINFRA | * | ALTA | 28,352 | 4,527,530.88 | 0.72 |
| 1 | WALMEX | * | ALTA | 100,000 | 6,540,000.00 | 1.05 |
| 1B | QVGMEX | 18 | BAJA | 1,878 | 43,269.12 | 0.01 |
| 1ISP | EEM | * | ALTA | 100 | 109,435.47 | 0.02 |
| 1ISP | GDX | * | ALTA | 136 | 106,924.86 | 0.02 |
| 1ISP | TLT | * | ALTA | 100 | 276,111.66 | 0.04 |
| TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES | | | | | 72,854,145.00 | 11.65 |
| OPERACIONES CON DERIVADOS | | | | | | |
| FUTUROS | | | | | | |
| FD | DEUA | JN21 | | 124 | -60,388.00 | -0.01 |
| FI | IPC | JN21 | | 3 | 18,720.00 | 0.00 |
| FI | IPC | JN21 | | 3 | 18,720.00 | 0.00 |
| FI | IPC | JN21 | | 3 | 18,720.00 | 0.00 |
| FI | IPC | JN21 | | 5 | 31,200.00 | 0.01 |
| FI | IPC | JN21 | | 1 | 6,240.00 | 0.00 |
| FI | IPC | JN21 | | 5 | 31,200.00 | 0.01 |
| FI | IPC | JN21 | | 1 | 6,240.00 | 0.00 |
| FI | IPC | JN21 | | 5 | 31,200.00 | 0.01 |
| TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS | | | | | 101,852.00 | 0.02 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 625,280,846.50 | 100.00 |

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.827%

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