

gbmfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0777794		1,922,000	1,922,211.00	0.29
BI	CETES	210701	mxAAA	90,475	903,434.76	0.14
EAIM	GBM-INT	0004721		5,258	5,258.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					2,830,903.76	0.43
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	GMEXICO	B	ALTA	292,723	25,361,520.72	3.87
1	PE&OLES	*	ALTA	41,826	11,852,651.88	1.81
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	1,500,256	22,383,819.52	3.41
1	ASUR	B	ALTA	22,931	8,634,209.43	1.32
1	GMXT	*	ALTA	364,227	12,176,108.61	1.86
1	OMA	B	ALTA	97,128	12,809,240.64	1.95
1	ORBIA	*	ALTA	242,187	12,886,770.27	1.96
1	PINFRA	*	ALTA	116,066	19,005,807.50	2.90
1	PINFRA	L	MEDIA	286,956	29,346,990.12	4.47
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	151,253	13,603,694.82	2.07
1	NMK	A	ALTA	4,140,909	13,168,090.62	2.01
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	175,625	20,103,793.75	3.06
1	BACHOCO	B	MEDIA	252,427	18,990,083.21	2.89
1	CHDRAUI	B	MEDIA	712,831	22,689,410.73	3.46
1	FEMSA	UBD	ALTA	116,713	19,955,588.74	3.04
1	KOF	UBL	ALTA	87,463	9,215,976.31	1.40
1	WALMEX	*	ALTA	201,479	12,783,842.55	1.95
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	GFNORTE	O	ALTA	142,472	18,698,025.28	2.85
1B	QVGMEX	18	BAJA	32,808	750,318.96	0.11
1ISP	DOG	*	ALTA	14,330	10,195,466.41	1.55
1ISP	EEM	*	ALTA	29,461	32,911,751.17	5.02
1ISP	GDX	*	ALTA	29,409	21,014,069.93	3.20
1ISP	GDXJ	*	NA	8,825	8,807,991.00	1.34
1ISP	PSQ	*	NA	62,022	16,163,913.77	2.46
1ISP	TLT	*	ALTA	3,312	9,691,235.78	1.48
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	3,076,873	48,614,593.40	7.41
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					451,814,965.12	68.86
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210701	mxAAA	615,501	6,146,062.46	0.94
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					6,146,062.46	0.94
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					457,961,027.58	69.80
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	221110	mxAAA	1,708,336	170,359,918.74	25.96
IM	BPAG28	230209	mxAAA	34,352	3,418,634.98	0.52
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					173,778,553.72	26.48
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AMX	L	ALTA	3,850	60,830.00	0.01
1	AMX	L	ALTA	14,800	233,840.00	0.04
1	KOF	UBL	ALTA	3,078	324,328.86	0.05
1	ORBIA	*	ALTA	91,996	4,895,107.16	0.75
1	ORBIA	*	ALTA	215,640	11,474,204.40	1.75
1	PINFRA	*	ALTA	27,347	4,478,071.25	0.68
1ISP	TLT	*	ALTA	100	292,609.78	0.04
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					21,758,991.45	3.32
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FD	DEUA	SP21		124	-188,852.00	-0.03
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-188,852.00	-0.03
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					656,140,624.51	100.00

CATEGORIA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.876%

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