

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0777794		3,612,000	3,612,907.00	0.64
BI	CETES	210923	mxAAA	165,233	1,651,071.75	0.29
EAIM	GBM-INT	0004721		5,107	5,107.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					5,269,085.75	0.93
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,330,039	20,163,391.24	3.55
1	GCC	*	ALTA	91,970	14,232,357.50	2.50
1	GMEXICO	B	ALTA	330,847	29,415,606.77	5.17
1	PE&OLES	*	ALTA	41,826	11,197,656.72	1.97
1	VITRO	A	BAJA	335,299	8,925,659.38	1.57
1ASP	NEM	*	NA	12,941	14,838,294.70	2.61
1E	FRES	*	BAJA	53,237	12,319,041.80	2.17
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	2,563,199	35,807,890.03	6.30
1	ASUR	B	ALTA	33,627	12,070,075.38	2.12
1	GAP	B	ALTA	41,745	9,763,738.05	1.72
1	GMXT	*	ALTA	364,227	10,945,021.35	1.92
1	OMA	B	ALTA	174,410	21,122,795.10	3.71
1	ORBIA	*	ALTA	406,259	22,388,933.49	3.94
1	PINFRA	*	ALTA	134,965	19,977,519.30	3.51
1	PINFRA	L	BAJA	286,956	28,683,969.96	5.04
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	82,818	7,142,224.32	1.26
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	252,427	19,199,597.62	3.38
1	FEMSA	UBD	ALTA	151,611	26,897,307.51	4.73
1	KOF	UBL	ALTA	68,236	7,875,116.76	1.38
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	Q	*	ALTA	95,343	9,264,479.31	1.63
1ASP	JPM	*	ALTA	1,943	6,105,687.01	1.07
1B	QVGMEX	18	BAJA	67,371	1,539,427.35	0.27
1ISP	EEM	*	ALTA	23,676	24,545,816.70	4.32
1ISP	GDX	*	ALTA	38,444	24,640,982.05	4.33
1ISP	GDXJ	*	NA	8,825	7,451,929.28	1.31
1ISP	PSQ	*	NA	166,207	38,240,446.17	6.72
1ISP	SIL	*	NA	11,186	8,823,286.93	1.55
1ISP	XLE	*	ALTA	14,936	14,914,952.34	2.62
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	836,494	15,751,182.02	2.77
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					484,244,386.14	85.14
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210923	mxAAA	548,101	5,476,836.21	0.96
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					5,476,836.21	0.96
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					489,721,222.35	86.10
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	220210	mxAAA	4,657,338	45,608,142.10	8.02
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					45,608,142.10	8.02
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AMX	L	ALTA	100,000	1,883,000.00	0.33
1	ASUR	B	ALTA	7,093	2,545,961.42	0.45
1	GAP	B	ALTA	3,405	796,395.45	0.14
1	KOF	UBL	ALTA	22,305	2,574,220.05	0.45
1	ORBIA	*	ALTA	158,473	8,733,447.03	1.54
1	ORBIA	*	ALTA	2,843	156,677.73	0.03
1	PINFRA	*	ALTA	71,654	10,606,225.08	1.86
1B	QVGMEX	18	BAJA	39,574	904,265.90	0.16
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					28,200,192.66	4.96
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FD	DEUA	DC21		124	63,364.00	0.01
FI	IPC	DC21		4	-12,400.00	0.00
FI	IPC	DC21		1	-3,100.00	0.00
FI	IPC	DC21		1	-3,100.00	0.00
FI	IPC	DC21		1	-3,100.00	0.00
FI	IPC	DC21		1	-3,100.00	0.00
FI	IPC	DC21		28	-86,800.00	-0.02
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-48,236.00	-0.01
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					568,750,406.86	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.944%

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