

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 19 AGOSTO, 2021

Tipo Valor	Emissora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AMI	GBM	0777794		3,612,000	3,612,451.00	0.59
BI	CETES	210923	mxAAA	165,796	1,650,915.83	0.27
EAIM	GBM-INT	0004721		5,192	5,192.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					5,268,558.83	0.86
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CENEX	CPO	ALTA	949,767	14,759,379.18	2.42
1	GMEXICO	B	ALTA	193,200	16,694,412.00	2.74
1	PE&OLES	A	ALTA	41,826	11,328,153.84	1.86
1	VITRO	*	BAJA	335,299	8,345,592.11	1.37
1	NEM	*	NA	7,552	8,822,382.03	1.41
1E	FRES	*	BAJA	27,186	6,306,880.14	1.03
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	2,109,935	28,019,936.89	4.59
1	ASUR	B	ALTA	22,931	7,827,466.85	1.28
1	GAP	B	ALTA	10,150	2,214,527.00	0.36
1	GMXT	B	ALTA	364,227	11,677,117.62	1.91
1	OMA	B	ALTA	95,125	11,275,165.25	1.85
1	ORBIA	*	ALTA	475,697	25,863,645.89	4.24
1	PINFRA	*	ALTA	205,591	30,711,183.58	5.03
1	PINFRA	*	BAJA	286,956	27,691,254.00	4.54
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVPOL	C-1	ALTA	80,296	7,118,240.40	1.17
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	B	ALTA	88,616	11,012,310.32	1.81
1	BACHOCO	B	MEDIA	252,427	18,030,860.61	2.96
1	FEMSA	UBD	ALTA	116,713	20,243,869.85	3.32
1	KOF	UBL	ALTA	62,192	7,155,811.52	1.17
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	GFNORTE	O	ALTA	42,472	5,376,530.48	0.88
1	O	*	ALTA	95,343	9,028,028.67	1.48
1B	QVGMEX	*B	BAJA	27,908	629,046.32	0.10
1ISP	DOG	*	ALTA	18,689	12,647,159.34	2.07
1ISP	EEM	*	ALTA	35,575	35,601,068.29	5.84
1ISP	GDX	*	ALTA	29,409	18,392,608.58	3.01
1ISP	GDKJ	*	NA	8,826	7,096,905.31	1.16
1ISP	IWM	*	ALTA	2,805	12,009,029.59	1.97
1ISP	PSQ	*	NA	166,207	40,457,447.27	6.63
1ISP	SIL	*	NA	11,186	8,482,643.25	1.39
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	BABA	N	NA	3,591	11,646,296.28	1.91
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	1,783,934	32,396,241.44	5.31
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					468,661,204.81	76.82
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210923	mxAAA	547,538	5,452,116.75	0.89
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					5,452,116.75	0.89
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					474,113,321.56	77.71
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211216	mxAAA	6,916,041	68,022,436.42	11.15
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					68,022,436.42	11.15
OPERACIONES DE PRESTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AC	*	ALTA	32,349	4,020,010.23	0.66
1	AC	*	ALTA	4,206	522,676.62	0.09
1	AC	*	ALTA	50,454	6,269,918.58	1.03
1	AMX	L	ALTA	9,500	172,520.00	0.03
1	AMX	L	ALTA	451,000	8,190,160.00	1.34
1	GAP	B	ALTA	35,000	7,636,300.00	1.25
1	GFNORTE	O	ALTA	100,000	12,659,000.00	2.07
1	KOF	UBL	ALTA	28,349	3,261,835.94	0.53
1	LIVPOL	C-1	ALTA	901	79,873.65	0.01
1	LIVPOL	C-1	ALTA	1,621	143,701.65	0.02
1	OMA	B	ALTA	75,876	8,993,582.28	1.47
1	ORBIA	*	ALTA	12,055	655,430.35	0.11
1	ORBIA	*	ALTA	181,530	9,869,786.10	1.62
1	PINFRA	*	ALTA	1,028	153,562.64	0.03
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					62,628,361.04	10.27
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FD	DEUA	SP21		124	-252,712.00	-0.04
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		2	17,840.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	8,920.00	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					66,408.00	0.01
TOTAL INVERSIÓN EN VALORES					610,101,085.85	100.00

CATEGORÍA	DISCRECIONAL
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 1.020%
	Limite 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