GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 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	3,612,459.00	0.59
BI	CETES	210923	mxAAA	165,533	1,650,791.42	0.27
EAIM	GBM-INT	0004721		5,160	5,160.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					**5.268.410.42**	**0.86**
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	374,039	6,171,643.50	1.01
1	GMEXICO	B	ALTA	264,073	24,704,029.15	4.05
1	PE&OLES	*	ALTA	41,826	11,903,261.34	1.95
1	VITRO	A	BAJA	335,299	8,382,475.00	1.37
1ASP	NEM	*	NA	12.941	15.067.131.57	2.47
1E	FRES	*	BAJA	53.237	12.416.973.23	2.03
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	2,563,199	36,141,105.90	5.92
1	ASUR	B	ALTA	13,497	4,864,723.71	0.80
1	GAP	B	ALTA	47	10,992.36	0.00
1	GMXT	*	ALTA	364,227	11,352,955.59	1.86
1	OMA	B	ALTA	213,912	25,932,551.76	4.25
1	ORBIA	*	ALTA	573,598	32,890,109.32	5.39
1	PINFRA	*	ALTA	187.316	28.097.400.00	4.60
1	PINFRA	L	BAJA	286,956	28,752,991.20	4.71
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	82,818	7,374,942.90	1.21
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	103,344	13,369,613.28	2.19
1	BACHOCO	B	MEDIA	252,427	18,540,763.15	3.04
1	FEMSA	UBD	ALTA	151,611	26,512,215.57	4.34
1	KOF	UBL	ALTA	42,556	4,947,986.12	0.81
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	GFNORTE	O	ALTA	142,472	18,888,937.76	3.09
1	Q	*	ALTA	95,343	9,081,420.75	1.49
1ASP	JPM	*	ALTA	1,943	6,239,742.67	1.02
1B	QVGMEX	18	BAJA	10,793	250,397.60	0.04
1ISP	DOG	*	ALTA	18,689	12,386,289.40	2.03
1ISP	EEM	*	ALTA	29,613	31,160,627.94	5.10
1ISP	GDX	*	ALTA	29,409	19,248,969.84	3.15
1ISP	GDXJ	*	NA	8.825	7.638.399.55	1.25
1ISP	PSQ	*	NA	166,207	38,475,852.62	6.30
1ISP	SIL	*	NA	11,186	9,053,098.54	1.48
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	BABA	N	NA	1,690	5,666,133.52	0.93
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	677,281	13,389,845.37	2.19
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					**488,913,580.21**	**80.08**
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210923	mxAAA	547,801	5,462,990.39	0.89
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					**5,462,990.39**	**0.89**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**494,376,570.60**	**80.98**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	220113	mxAAA	3,928,984	38,547,579.70	6.31
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**38,547,579.70**	**6.31**
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AC	*	ALTA	28,409	3,675,272.33	0.60
1	AC	*	ALTA	23,627	3,056,624.99	0.50
1	AC	*	ALTA	18,431	2,384,418.47	0.39
1	AC	*	ALTA	1,814	234,677.18	0.04
1	AMX	L	ALTA	4,500	88,965.00	0.01
1	AMX	L	ALTA	582,063	11,507,385.51	1.88
1	AMX	L	ALTA	5,000	98,850.00	0.02
1	ASUR	B	ALTA	2,213	797,631.59	0.13
1	ASUR	B	ALTA	25,010	9,014,354.30	1.48
1	CEMEX	CPO	ALTA	930,000	15,345,000.00	2.51
1	CEMEX	CPO	ALTA	26,000	429,000.00	0.07
1	GAP	B	ALTA	10,000	2,338,800.00	0.38
1	GAP	B	ALTA	600	140,328.00	0.02
1	GAP	B	ALTA	30,000	7,016,400.00	1.15
1	GAP	B	ALTA	4,503	1,053,161.64	0.17
1	KOF	UBL	ALTA	1,119	130,106.13	0.02
1	KOF	UBL	ALTA	46,078	5,357,489.06	0.88
1	KOF	UBL	ALTA	788	91,620.76	0.02
1	OMA	B	ALTA	7,900	957,717.00	0.16
1	ORBIA	*	ALTA	34,610	1,984,537.40	0.33
1	ORBIA	*	ALTA	55,913	3,206,051.42	0.53
1	ORBIA	*	ALTA	5,161	295,931.74	0.05
1	PINFRA	*	ALTA	8,344	1,251,600.00	0.21
1	PINFRA	*	ALTA	10,959	1,643,850.00	0.27
1B	OVGMEX	18	BAJA	19.115	443.468.00	0.07
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					**72,543,240.52**	**11.88**
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FD	DEUA	SP21		124	53,320.00	0.01
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		2	-14,720.00	0.00
FI	IPC	SP21		3	-22,080.00	0.00
FI	IPC	SP21		3	-22,080.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		2	-14,720.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	-7,360.00	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					**-211,640.00**	**-0.03**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**610,524,161.24**	**100.00**

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.994%

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

Ing. Fernando Castro Tapia