

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V. F.R.V. CARTERA DE VALORES AL 09 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	3,612,452.00	0.62
BI	CETES	210923	mxAAA	165,356	1,650,829.97	0.28
EAIM	GBMANT	0004721		5,125	5,125.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					5,268,406.97	0.91
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	130,039	1,986,995.92	0.34
1	GCC	*	ALTA	91,970	14,456,764.30	2.49
1	GMEXICO	B	ALTA	330,847	28,416,448.83	4.89
1	PE&LES	*	ALTA	41,826	11,092,255.20	1.91
1	VTRO	A	BAJA	335,299	6,734,538.95	1.50
1ASP	NEM	*	NA	12,941	14,789,216.93	2.54
1E	FRES	*	BAJA	53,237	12,196,596.70	2.10
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	2,563,109	35,320,882.22	6.08
1	ASUR	B	ALTA	25,720	9,345,619.20	1.61
1	GAP	B	ALTA	2,150	500,821.00	0.09
1	GMXT	*	ALTA	364,227	11,108,923.50	1.91
1	OMA	B	ALTA	174,410	21,389,642.40	3.68
1	ORBA	*	ALTA	550,637	30,835,672.00	5.30
1	PINFRA	*	ALTA	180,579	27,390,222.72	4.71
1	PINFRA	L	BAJA	286,956	28,695,600.00	4.94
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	82,818	7,162,100.64	1.23
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	252,427	18,808,335.77	3.24
1	FEMSA	UBD	ALTA	151,611	25,698,064.50	4.42
1	KOF	UBL	ALTA	86,817	9,799,166.62	1.68
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	Q	*	ALTA	95,343	9,315,964.53	1.60
1ASP	JPM	*	ALTA	1,943	6,187,874.34	1.06
1B	QVGMEX	18	BAJA	108,845	2,456,453.45	0.42
1ISP	EEM	*	ALTA	23,676	24,810,069.75	4.27
1ISP	GDX	*	ALTA	38,444	24,500,913.26	4.21
1ISP	GDJ	*	NA	8,825	7,320,739.92	1.26
1ISP	PSQ	*	NA	166,207	36,247,411.90	6.58
1ISP	SIL	*	NA	11,186	8,837,638.23	1.52
1ISP	XLE	*	ALTA	14,936	14,239,671.88	2.45
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX		ALTA	936,494	17,512,437.80	3.01
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					471,136,052.46	81.04
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210923	mxAAA	547,978	5,470,732.88	0.94
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					5,470,732.88	0.94
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					476,606,785.34	81.98
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211216	mxAAA	304	2,998.95	0.00
BI	CETES	220113	mxAAA	6,138,057	60,289,842.29	10.37
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					60,292,841.24	10.37
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	ASUR	B	ALTA	15,000	5,450,400.00	0.94
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,200,000	18,336,000.00	3.15
1	GAP	B	ALTA	35,000	8,152,900.00	1.40
1	GAP	B	ALTA	9,000	1,863,520.00	0.32
1	KOF	UBL	ALTA	3,724	420,290.64	0.07
1	ORBA	*	ALTA	6,438	360,528.00	0.06
1	ORBA	*	ALTA	10,500	588,000.00	0.10
1	PINFRA	*	ALTA	294	44,593.92	0.01
1	PINFRA	*	ALTA	25,746	3,905,153.28	0.67
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					39,121,385.84	6.73
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FD	DEUA	DC21		124	13,268.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		2	1,960.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
FI	IPC	SP21		1	980.00	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					48,548.00	0.01
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					581,337,967.39	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.958%

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