

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 04 MARZO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0777794		3,252,000	3,252,355.00	0.55
BI	CETES	210422	mxAAA	153,689	1,528,615.08	0.26
EAIM	GBM-INT	0004721		5,426	5,426.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					4,786,396.08	0.81
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1	IENOV	+	ALTA	301,418	22,115,038.66	3.72
EMPRESAS MATERIALES						
1	GMEXICO	B	ALTA	88,643	8,913,053.65	1.50
1ASP	NEW	+	NA	13,966	16,363,998.18	2.75
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	1,908,572	22,425,721.00	3.77
1	ASUR	B	ALTA	22,910	8,453,560.90	1.42
1	GMXT	B	ALTA	452,452	12,578,165.60	2.12
1	OMA	+	ALTA	48,014	6,336,887.72	1.07
1	ORBIA	+	ALTA	722,852	36,128,142.96	6.08
1	PINFRA	+	ALTA	86,202	13,412,169.18	2.26
1	PINFRA	L	MEDIA	286,795	29,088,568.33	4.90
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	+	ALTA	755,687	20,071,046.72	3.38
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	474,996	30,480,493.32	5.13
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	+	ALTA	170,708	16,809,616.76	2.83
1	BACHOCO	B	MEDIA	252,427	17,515,909.53	2.95
1	CHDRAUI	B	MEDIA	610,104	19,151,164.56	3.22
1	FEMSA	UBD	ALTA	116,713	17,694,857.93	2.98
1	GRUMA	B	ALTA	45,593	10,722,561.74	1.80
1	KOF	UBL	ALTA	86,181	8,288,888.58	1.39
1	WALMEX	+	ALTA	135,205	8,634,191.30	1.45
1ASP	COST	+	ALTA	853	5,745,443.33	0.97
1ASP	PEP	+	ALTA	2,129	5,790,579.73	0.97
1ASP	WMT	+	ALTA	2,158	5,810,228.03	0.98
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	GFNORTE	O	ALTA	112,972	12,229,219.00	2.06
1B	OVGMEX	1B	MEDIA	17,700	365,744.00	0.06
1ISP	EEM	+	ALTA	7,470	8,397,878.58	1.41
1ISP	EWZ	+	ALTA	23,600	16,103,220.22	2.71
1ISP	GDX	+	ALTA	25,045	16,586,888.75	2.79
1ISP	TIT	+	ALTA	2,965	8,678,459.17	1.46
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	BABA	N	NA	1,133	5,513,536.03	0.93
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	364,962	5,047,424.46	0.85
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					415,453,657.92	69.91
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210408	mxAAA	200,783	2,000,160.49	0.34
BI	CETES	210422	mxAAA	349,509	3,476,271.74	0.59
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					5,476,432.23	0.92
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					420,930,090.15	70.84
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDES	240627	mxAAA	655,333	65,724,840.61	11.06
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					65,724,840.61	11.06
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AC	+	ALTA	4,917	484,176.99	0.08
1	ALSEA	+	ALTA	2,161	57,396.16	0.01
1	AMX	L	ALTA	135,000	1,867,050.00	0.31
1	AMX	L	ALTA	189,361	2,618,862.63	0.44
1	AMX	L	ALTA	2,406,200	33,277,746.00	5.60
1	ASUR	B	ALTA	21	7,748.79	0.00
1	CHDRAUI	B	MEDIA	2,727	85,600.53	0.01
1	CHDRAUI	B	MEDIA	100,000	3,139,000.00	0.53
1	GFNORTE	O	ALTA	33,939	3,673,896.75	0.62
1	GFNORTE	O	ALTA	92,100	9,969,825.00	1.68
1	IENOV	+	ALTA	12,190	894,380.30	0.15
1	IENOV	+	ALTA	200,000	14,674,000.00	2.47
1	KOF	UBL	ALTA	4,360	419,344.80	0.07
1	OMA	B	ALTA	87,049	11,488,727.02	1.93
1	ORBIA	+	ALTA	18,800	939,624.00	0.16
1	ORBIA	+	ALTA	12,323	615,903.54	0.10
1	PINFRA	+	ALTA	1,732	269,481.88	0.05
1	PINFRA	+	ALTA	15,643	2,433,894.37	0.41
1	WALMEX	+	ALTA	2,000	127,720.00	0.02
1	WALMEX	+	ALTA	206,337	13,176,680.82	2.22
1	WALMEX	+	ALTA	44,700	2,854,542.00	0.48
1ISP	EEM	+	ALTA	100	112,421.40	0.02
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					103,188,022.98	17.36
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FD	DEUA	MR21		10	-17,500.00	0.00
FD	DEUA	MR21		112	-196,000.00	-0.03
FD	DEUA	MR21		2	-3,500.00	0.00
FI	IPC	MR21		5	-22,600.00	0.00
FI	IPC	MR21		5	-22,600.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	-4,520.00	0.00
FI	IPC	MR21		2	-9,040.00	0.00
FI	IPC	MR21		2	-9,040.00	0.00
FI	IPC	MR21		4	-18,080.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	-4,520.00	0.00
FI	IPC	MR21		4	-18,080.00	0.00
FI	IPC	MR21		2	-9,040.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	-4,520.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	-4,520.00	0.00
FI	IPC	MR21		2	-9,040.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	-4,520.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	-4,520.00	0.00
FI	IPC	MR21		5	-22,600.00	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-388,760.00	-0.07
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					594,240,589.82	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.711%

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