

GBMfondos

SAURORT SAURO CAPITAL FUND S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 26 FEBRERO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0777794		1,330,000	1,330,444.00	0.23
BI	CETES	210422	mxAAA	62,896	625,301.97	0.11
EAIM	GBM-INT	0004721		5,380	5,380.00	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,961,125.97	0.33
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1	ENOVA	*	ALTA	500,750	36,459,607.50	6.21
EMPRESAS MATERIALES						
1	GMEXICO	B	ALTA	143,113	14,215,414.29	2.42
1ASP	NEM	*	NA	13,986	15,921,535.41	2.71
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	1,908,572	21,738,635.08	3.71
1	ASUR	B	ALTA	21,631	8,467,022.33	1.44
1	GMXT	*	ALTA	452,452	12,573,641.08	2.14
1	OMA	B	ALTA	135,063	16,391,245.68	2.79
1	ORBITA	*	ALTA	650,255	31,725,941.45	5.41
1	PINFRA	*	ALTA	76,242	11,732,118.96	2.00
1	PINFRA	L	MEDIA	286,795	29,826,680.00	5.08
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTA	757,848	19,279,653.12	3.29
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	474,996	30,081,496.68	5.13
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	29,016	2,749,846.32	0.47
1	BACHOCO	B	MEDIA	252,427	17,523,482.34	2.99
1	CHDRAUI	B	ALTA	712,740	22,878,954.00	3.90
1	FEMSA	UBD	ALTA	116,713	16,706,298.82	2.85
1	GRUMA	B	ALTA	45,593	10,396,115.86	1.77
1	KOF	UBL	ALTA	88,801	7,795,839.79	1.33
1	WALMEX	*	ALTA	232,809	13,894,041.12	2.37
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	GFNORTE	O	ALTA	132,415	13,911,519.90	2.37
1B	QVGMEX	18	BAJA	13,700	277,836.00	0.05
1ISP	EEM	*	ALTA	7,570	8,514,613.52	1.45
1ISP	EWZ	*	ALTA	23,600	15,759,952.56	2.69
1ISP	GDY	*	ALTA	25,045	16,321,210.89	2.78
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	BABA	N	NA	1,133	5,639,244.46	0.96
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	1,198,232	16,044,326.48	2.73
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					416,826,273.64	71.05
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210422	mxAAA	440,302	4,377,412.04	0.75
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					4,377,412.04	0.75
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					421,203,685.68	71.79
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAC28	220811	mxAAA	795,083	79,182,587.66	13.50
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					79,182,587.66	13.50
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AC	*	ALTA	200,000	18,954,000.00	3.23
1	AC	*	ALTA	3,806	360,694.62	0.06
1	AMX	L	ALTA	104,000	1,392,560.00	0.24
1	AMX	L	ALTA	1,000,000	13,390,000.00	2.28
1	AMX	L	ALTA	135,000	1,807,650.00	0.31
1	AMX	L	ALTA	658,291	8,814,516.49	1.50
1	ASUR	B	ALTA	1,300	508,859.00	0.09
1	CHDRAUI	B	ALTA	91	2,921.10	0.00
1	GFNORTE	O	ALTA	2,600	273,156.00	0.05
1	GFNORTE	O	ALTA	11,896	1,249,793.76	0.21
1	GFNORTE	O	ALTA	92,100	9,676,026.00	1.65
1	ENOVA	*	ALTA	2,012	146,493.72	0.03
1	ENOVA	*	ALTA	10,846	789,697.26	0.13
1	KOF	UBL	ALTA	1,740	152,754.60	0.03
1	ORBITA	*	ALTA	3,808	185,792.32	0.03
1	ORBITA	*	ALTA	99,912	4,874,706.48	0.83
1	PINFRA	*	ALTA	9,823	1,511,563.24	0.26
1	PINFRA	*	ALTA	17,512	2,694,746.56	0.46
1	WALMEX	*	ALTA	250,000	14,920,000.00	2.54
1	WALMEX	*	ALTA	10,000	596,800.00	0.10
1	WALMEX	*	ALTA	32,700	1,951,536.00	0.33
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					84,254,267.15	14.36
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FI	IPC	MR21		1	2,680.00	0.00
FI	IPC	MR21		2	5,360.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	2,680.00	0.00
FI	IPC	MR21		4	10,720.00	0.00
FI	IPC	MR21		2	5,360.00	0.00
FI	IPC	MR21		2	5,360.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	2,680.00	0.00
FI	IPC	MR21		5	13,400.00	0.00
FI	IPC	MR21		5	13,400.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	2,680.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	2,680.00	0.00
FI	IPC	MR21		2	5,360.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	2,680.00	0.00
FI	IPC	MR21		5	13,400.00	0.00
FI	IPC	MR21		4	10,720.00	0.00
FI	IPC	MR21		1	2,680.00	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					101,840.00	0.02
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					586,703,506.46	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.710%

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