



VALORLP COMPASS INVESTMENTS SIETE, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable  
CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>						
CHD	BANSAN	0385148		21,897	435,055.38	0.03
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>435,055.38</b>	<b>0.03</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS ENERGÉTICAS</b>						
1ESP	SRE	*	NA	18,064	48,866,190.88	3.73
<b>EMPRESAS MATERIALES</b>						
1	GCC	*	ALTA	438,500	67,857,875.00	5.19
1	GMEXICO	B	ALTA	712,000	63,303,920.00	4.84
1	PE&OLES	*	ALTA	43,373	11,611,819.56	0.89
1ESP	FRES	*	BAJA	67,612	15,645,416.80	1.20
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	AGUA	*	MEDIA	1,568,600	49,567,760.00	3.79
1	ALFA	A	ALTA	4,687,381	65,482,712.57	5.00
1	GMXT	*	ALTA	1,613,987	48,500,309.35	3.71
1	ORBITA	*	ALTA	1,666,500	91,840,815.00	7.02
1	PINFRA	L	BAJA	1,515,000	151,438,598.57	11.57
1	VESTA	*	ALTA	894,601	32,805,018.67	2.51
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	ALSEA	*	ALTA	808,244	32,984,437.64	2.52
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	629,536	54,291,184.64	4.15
1	NEMAK	A	ALTA	5,485,944	33,025,382.88	2.52
<b>EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>						
1	BACHOCO	B	MEDIA	573,600	43,628,016.00	3.33
1	GRUMA	B	ALTA	211,300	49,900,608.00	3.81
1	LACOMER	UBC	MEDIA	656,000	23,937,440.00	1.83
1	WALMEX	*	ALTA	344,000	24,609,760.00	1.88
<b>EMPRESAS DE SALUD</b>						
1	FRAGUA	B	MEDIA	219,817	68,143,270.00	5.21
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
CF	DANHOS	13	MEDIA	2,066,200	50,993,816.00	3.90
FE	FCFE	18	MEDIA	2,007,700	58,183,146.00	4.45
1	GFNORTE	O	ALTA	276,700	36,178,525.00	2.76
1ISP	SHV	*	ALTA	14,000	30,728,224.73	2.35
41	BSMX	B	ALTA	2,096,000	47,893,600.00	3.66
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>						
1	AMX	L	ALTA	3,175,900	59,802,197.00	4.57
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>1,261,220,044.29</b>	<b>96.37</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>1,261,220,044.29</b>	<b>96.37</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
LD	BONDESD	221013	mxAAA	470,971	47,043,856.89	3.59
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>47,043,856.89</b>	<b>3.59</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>1,308,698,956.56</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
DISCRECIONAL

**CALIFICACIÓN**  
NA

**VaR Promedio**  
1.557%

**Límite de VaR**  
4.000%

El Fondo de inversión no se encuentra en una estrategia temporal de inversión

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico de volatilidad estable, con un horizonte temporal de 28 días que utiliza los 320 datos más recientes para componer el 50% de la volatilidad y otros 1600 datos anteriores para componer el otro 50%.