



VALORLP COMPASS INVESTMENTS SIETE, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANSAN	0385148		1,638	33,505.50	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					33,505.50	0.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1ESP	SRE	*	NA	20,044	57,631,110.12	4.35
EMPRESAS MATERIALES						
1	GCC	*	ALTA	414,500	61,569,830.00	4.64
1	GMEXICO	B	ALTA	712,000	61,687,680.00	4.65
1	PE&QLES	*	ALTA	43,373	12,291,040.74	0.93
1ESP	FRES	*	BAJA	52,612	13,134,585.80	0.99
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AGUA	*	MEDIA	1,568,600	54,681,396.00	4.12
1	ALFA	A	ALTA	4,606,381	68,727,204.52	5.18
1	GMXT	*	ALTA	1,613,987	53,955,585.41	4.07
1	ORBIA	*	ALTA	1,565,000	83,273,650.00	6.28
1	PASA	B	MINIMA	1,700,367	19,554,220.50	1.48
1	PINFRA	L	MEDIA	1,515,000	154,939,050.00	11.69
1	VESTA	*	ALTA	640,000	26,220,800.00	1.98
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTA	1,018,000	37,686,360.00	2.84
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	696,000	62,598,240.00	4.72
1	NMK	A	ALTA	11,618,881	36,948,041.58	2.79
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	212,000	24,267,640.00	1.83
1	BACHOCO	B	MEDIA	573,600	43,151,928.00	3.25
1	GRUMA	B	ALTA	211,300	47,417,833.00	3.58
1	WALMEX	*	ALTA	488,000	30,963,600.00	2.34
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	219,817	69,846,851.75	5.27
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
CF	DANHOS	13	ALTA	2,034,200	48,597,038.00	3.67
FE	FCFE	18	MEDIA	2,007,700	56,416,370.00	4.26
1ISP	SHY	*	ALTA	18,000	31,731,099.97	2.39
41	BSMX	B	ALTA	2,096,000	53,552,800.00	4.04
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	5,230,000	82,634,000.00	6.23
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,293,477,955.39	97.57
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,293,477,955.39	97.57
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	240822	mxAAA	323,344	32,228,464.56	2.43
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					32,228,464.56	2.43
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,325,739,925.45	100.00

CATEGORIA
DISCRECIONAL

CALIFICACION
NA

VaR Promedio
1.573%

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%.

Jose Ignacio Armendariz Morales