



AMVALOR COMPASS INVESTMENTS SIETE, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 09 MAYO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	PINFRA	L	MEDIA	1,670,100	225,463,500.00	14.38
1	FRAGUA	B	MEDIA	137,700	110,160,000.00	7.03
1	GFNORTE	O	ALTA	596,000	104,449,000.00	6.66
1	GCC	*	ALTA	504,000	100,618,560.00	6.42
1	ASUR	B	ALTA	169,000	98,297,160.00	6.27
1	GMEXICO	B	ALTA	918,670	95,477,373.10	6.09
1	WALMEX	*	ALTA	1,232,000	84,194,880.00	5.37
1	AMX	B	ALTA	4,480,000	76,249,600.00	4.86
1	FEMSA	UBD	ALTA	343,000	69,910,260.00	4.46
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	466,000	67,649,220.00	4.32
1	ALSEA	*	ALTA	850,000	62,203,000.00	3.97
1	GMXT	*	MEDIA	1,619,600	60,459,668.00	3.86
1	PINFRA	*	ALTA	285,400	54,080,446.00	3.45
1	ORBIA	*	ALTA	1,799,000	52,260,950.00	3.33
1	CYDSASA	A	MEDIA	2,333,374	44,847,448.28	2.86
1	VESTA	*	ALTA	698,000	43,157,340.00	2.75
1	MEGA	CPO	ALTA	710,000	37,679,700.00	2.40
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				12,780,020	123,188,097.84	7.86
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,510,346,203.22	96.35
REPORTO						
IM	BPAG28	270204	mxAAA	573,689	57,271,472.23	3.65
TOTAL REPORTO					57,271,472.23	3.65
OTROS VALORES				1,220	20,481.43	0.00
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,567,638,156.88	100.00

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA RVDIS	VaR Promedio	Límite de VaR
NA		1.602%	4.000%

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%.