



COMPASS

TAURUM COMPASS INVESTMENTS DIECISIETE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE SEGUROS Y FIANZAS						
0	UNIFIN	A	NULA	2,066,754	18,351,390.79	33.78
CERTIFICADOS DE CAPITAL DE DESARROLLO						
1R	ARTHACK	10	NULA	300,000	31,906,538.40	58.73
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					50,257,929.19	92.51
REPORTO						
LF	BONDEF	260226	mxAAA	35,828	3,583,260.90	6.60
TOTAL REPORTO					3,583,260.90	6.60
OTROS VALORES				5,943,168	486,337.40	0.90
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					54,327,527.49	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.803%

Límite de VaR
5.000%

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 un día que utiliza los 320 datos más recientes para componer el 50% de la volatilidad y otros 1600 datos anteriores para componer el otro 50%.

Iván Alejandro Ramil Flores