



COMPASS

TAURUM COMPASS INVESTMENTS DIECISIETE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 02 MAYO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE SEGUROS Y FIANZAS						
0	UNIFIN	A	NULA	20,667,547	170,073,905.62	59.89
CERTIFICADOS DE CAPITAL DE DESARROLLO						
1R	ARTHACK	10	NULA	300,000	34,448,250.00	12.13
PAGARÉ CON RENDIMIENTO LIQUIDABLE AL VENCIMIENTO						
I	BANOBRA	24185	mxA-1+	78,990,138	78,990,138.00	27.81
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					283,512,293.62	99.83
OTROS VALORES				5,943,168	484,787.04	0.17
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					283,997,080.66	100.00

	CATEGORÍA RVDIS	
CALIFICACIÓN NA	VaR Promedio 3.409%	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