



PAM COMPASS INVESTMENTS OCHO, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 09 JUNIO, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANSAN	0385151		6,971	137,107.42	0.17
TOTAL DISPONIBILIDADES					137,107.42	0.17
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1ASP	COP	*	ALTA	550	1,282,523.99	1.62
1ASP	CVX	*	ALTA	360	1,256,939.59	1.58
1ASP	VLO	*	ALTA	470	1,325,689.78	1.67
1ASP	XOM	*	ALTA	640	1,288,094.02	1.62
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTA	151,580	4,104,786.40	5.17
1	GCC	*	ALTA	17,950	2,367,964.00	2.98
1	GMEXICO	B	ALTA	15,881	1,489,796.61	1.88
1ASP	SCCO	*	ALTA	4,330	5,203,478.00	6.56
1ASP	TX	*	ALTA	2,400	1,913,637.19	2.41
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	GAP	B	ALTA	5,600	1,596,784.00	2.01
1	ORBIA	*	ALTA	33,171	1,731,526.20	2.18
1	VOLAR	A	ALTA	81,760	2,308,084.80	2.91
1ASP	FDX	*	ALTA	370	1,579,159.78	1.99
1ASP	META	*	NULA	546	1,975,946.04	2.49
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTA	41,500	1,806,910.00	2.28
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	15,809	1,608,091.48	2.03
1ASP	CROX	*	ALTA	1,050	1,188,706.67	1.50
1ASP	MC	N	ALTA	50	614,083.31	0.77
1ASP	MCD	*	ALTA	420	2,000,397.55	2.52
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BIMBO	A	ALTA	6,800	438,736.00	0.55
1	FEMSA	UBD	ALTA	15,900	2,283,081.00	2.88
1	GRUMA	B	ALTA	2,100	494,424.00	0.62
1	LACOMER	UBC	ALTA	28,500	1,065,900.00	1.34
1	WALMEX	*	ALTA	83,263	5,711,841.80	7.20
1ASP	EL	*	ALTA	270	1,374,282.04	1.73
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
FE	FCFE	18	MEDIA	142,294	3,627,074.06	4.57
1	GFNORTE	O	ALTA	44,100	5,329,485.00	6.71
1ASP	BAC	*	ALTA	1,030	699,112.07	0.88
1ASP	COF	*	ALTA	280	657,216.84	0.83
1ASP	GS	*	ALTA	190	1,136,857.36	1.43
1ASP	JPM	*	ALTA	360	887,263.97	1.12
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	AVGO	*	ALTA	100	1,093,984.62	1.38
1ASP	GOOGL	*	ALTA	33	1,490,681.00	1.88
1ASP	HPQ	*	ALTA	2,200	1,586,712.37	2.00
1ASP	MSFT	*	ALTA	397	2,067,553.24	2.60
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	261,100	5,088,839.00	6.41
1ASP	DIS	*	ALTA	290	589,200.27	0.74
1ASP	TMUS	*	ALTA	590	1,543,595.74	1.94
EMPRESAS DE SERVICIOS PÚBLICOS						
1ASP	SO	*	ALTA	920	1,318,925.89	1.66
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					75,127,365.68	94.64
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					75,127,365.68	94.64
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	250416	mxAAA	41,186	4,115,746.05	5.18
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					4,115,746.05	5.18
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					79,380,219.15	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.334%

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, 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%.

Jose Ignacio Armendariz Morales