



COMPASS

ALPHA+ COMPASS INVESTMENTS QUINCE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJO	O	ALTA	186,835	7,828,386.50	3.18
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	FEMSA	UBD	ALTA	124,815	23,253,034.50	9.43
1	GMEXICO	B	ALTA	204,694	20,954,524.78	8.50
1	AMX	B	ALTA	1,260,876	19,442,707.92	7.89
1	WALMEX	*	ALTA	337,179	18,558,332.16	7.53
1	KOF	UBL	ALTA	115,056	18,191,504.16	7.38
1	GAP	B	ALTA	34,430	12,779,727.40	5.18
1	LAB	B	ALTA	447,836	12,028,874.96	4.88
1	AC	*	ALTA	70,922	11,891,491.74	4.82
1	ALFA	A	ALTA	752,916	11,677,727.16	4.74
1	GFNORTE	O	ALTA	80,562	11,583,204.36	4.70
1	GENTERA	*	ALTA	423,176	11,011,039.52	4.47
1	ASUR	B	ALTA	19,896	10,700,665.68	4.34
1	ALPEK	A	MEDIA	762,476	10,354,424.08	4.20
1	GCC	*	ALTA	47,197	8,462,422.10	3.43
1	CEMEX	CPO	ALTA	641,770	7,033,799.20	2.85
1	BIMBO	A	ALTA	93,574	5,847,439.26	2.37
1	VESTA	*	ALTA	108,700	5,600,224.00	2.27
1	OMA	B	ALTA	30,700	5,153,916.00	2.09
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FIBRAPL	14	ALTA	93,537	6,006,946.14	2.44
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					238,360,391.62	96.67
OTROS VALORES				579,418	8,200,438.29	3.33
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					246,560,829.91	100.00

	CATEGORÍA	
	RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
NA	1.642%	4.500%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico de volatilidad estable, Un modelo paramétrico lineal calcula el VAR usando formulas analíticas basadas en una distribución paramétrica para los rendimientos de los factores de riesgo, cuando el valor de laratera es una funcion lineal de sus factores de riesgo.