

VINCI COMPASS

ALPHA+ COMPASS INVESTMENTS QUINCE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 20 FEBRERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	FEMSA	UBD	ALTA	145,915	26,736,005.45	9.72
1	GFNORTE	O	ALTA	171,062	26,531,716.20	9.65
1	AMX	B	ALTA	1,725,879	25,974,478.95	9.45
1	WALMEX	*	ALTA	356,479	20,130,369.13	7.32
1	KOF	UBL	ALTA	100,659	17,323,413.90	6.30
1	GMEXICO	B	ALTA	159,494	16,750,059.88	6.09
1	AC	*	ALTA	73,494	15,353,631.54	5.58
1	GRUMA	B	ALTA	34,941	12,400,211.49	4.51
1	OMA	B	ALTA	52,400	11,065,308.00	4.02
1	GCC	*	ALTA	49,697	10,922,406.66	3.97
1	LAB	B	ALTA	397,074	10,867,915.38	3.95
1	CEMEX	CPO	ALTA	754,470	10,298,515.50	3.75
1	ALSEA	*	ALTA	195,286	9,744,771.40	3.54
1	ALFA	A	ALTA	542,705	9,274,828.45	3.37
1	PINFRA	*	ALTA	39,041	8,405,136.89	3.06
1	KIMBER	A	ALTA	249,500	8,073,820.00	2.94
1	ASUR	B	ALTA	13,495	7,847,747.35	2.85
1	R	A	ALTA	52,400	7,289,888.00	2.65
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				190,418	6,302,536.84	2.29
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					261,292,761.01	95.04
REPORTO						
LF	BONDEF	270923	mxAAA	100,601	10,026,781.21	3.65
TOTAL REPORTO					10,026,781.21	3.65
OTROS VALORES				36,170	3,606,801.79	1.31
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					274,926,344.01	100.00

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA	VaR Promedio	Límite de VaR
NA	RVESACC	1.688%	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 la cartera es una función lineal de sus factores de riesgo.

Iván Alejandro Ramil Flores