

VINCI COMPASS

BX+4 COMPASS INVESTMENTS CATORCE, S.A. DE C.V., Sociedad de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 28 FEBRERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	329,186	15,224,852.50	2.84
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ASP	NOVOB	N	ALTA	10,446	19,321,018.77	3.60
1ASP	BABA	N	ALTA	7,052	19,229,515.47	3.59
1ASP	MC	N	ALTA	1,286	19,126,951.83	3.57
1ASP	ASML	N	ALTA	1,243	18,053,751.81	3.37
1ASP	MELI	N	ALTA	340	14,845,850.18	2.77
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TII)				10,430	16,886,036.72	3.15
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	GENTERA	*	ALTA	658,235	18,772,862.20	3.50
1	AC	*	ALTA	71,163	15,107,193.27	2.82
1	ALSEA	*	ALTA	316,428	14,179,138.68	2.64
1	BOLSA	A	ALTA	338,708	12,352,680.76	2.30
1	MEGA	CPO	ALTA	280,197	11,539,736.95	2.15
1	LIVPOL	C-1	ALTA	112,908	11,400,320.76	2.13
1	WALMEX	*	ALTA	208,377	11,331,541.26	2.11
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,209,627	46,971,545.52	8.76
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	CBXMAS	0505504		70,142,022	70,197,925.33	13.09
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IVV	*	ALTA	2,089	25,665,471.81	4.79
1ISP	SGOV	*	ALTA	11,527	23,874,674.33	4.45
1ISP	XLV	*	ALTA	7,080	21,698,156.19	4.05
1ISP	XLF	*	ALTA	19,171	20,585,253.80	3.84
1ISP	KWEB	*	ALTA	28,622	19,984,404.93	3.73
1ISP	RSP	*	ALTA	5,270	19,540,001.00	3.64
1ISP	GLD	*	ALTA	3,573	19,357,165.96	3.61
1ISP	XLE	*	ALTA	7,204	13,490,327.10	2.52
1ISP	EWZ	*	ALTA	23,417	11,618,119.79	2.17
1ISP	COMT	*	ALTA	21,479	11,368,218.34	2.12
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					521,722,715.26	97.30
OTROS VALORES				316,415	14,456,186.93	2.70
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					536,178,902.19	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
NA	0.935%	4.600%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico de volatilidad estable, con un horizonte temporal de 1 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%.