



COLRVL COMPASS INVESTMENTS VEINTE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	240,559	14,977,203.34	12.01
1	GMEXICO	B	ALTA	124,103	12,212,976.23	9.79
1	FEMSA	UBD	ALTA	53,735	10,576,660.05	8.48
1	GFNORTE	O	ALTA	62,960	8,975,577.60	7.20
1	AMX	B	ALTA	554,669	8,636,196.33	6.93
1	CEMEX	CPO	ALTA	514,423	6,023,893.33	4.83
1	BOLSA	A	ALTA	163,238	5,057,113.24	4.06
1	MEGA	CPO	ALTA	105,837	4,866,385.26	3.90
1	CUERVO	*	ALTA	136,207	4,504,365.49	3.61
1	GENTERA	*	ALTA	170,524	3,867,484.32	3.10
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	28,500	3,737,490.00	3.00
1	HCITY	*	MEDIA	844,155	3,545,451.00	2.84
1	KIMBER	A	ALTA	109,972	3,480,613.80	2.79
1	ASUR	B	ALTA	6,142	3,383,013.60	2.71
1	GCC	*	ALTA	19,298	3,308,256.14	2.65
1	GRUMA	B	ALTA	9,565	3,192,701.35	2.56
1	GAP	B	ALTA	8,933	2,556,445.94	2.05
1	ALPEK	A	MEDIA	189,126	2,509,702.02	2.01
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				954,405	8,453,967.69	6.78
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					113,865,496.73	91.32
REPORTO						
LF	BONDESF	260226	mxAAA	61,008	6,101,584.82	4.89
TOTAL REPORTO					6,101,584.82	4.89
OTROS VALORES				165,933	4,724,901.75	3.79
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					124,691,983.30	100.00

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA RVESACC	VaR Promedio	Límite de VaR
NA		1.500%	2.600%

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, Un modelo parametrico lineal calcula el VAR usando formulas analiticas basadas en una distribucion parametrica para los rendimientos de los factores de riesgo, cuando el valor de la cartera es una funcion lineal de sus factores de riesgo.

Iván Alexandro Ramil Flores