



COMPASS

COLRVL COMPASS INVESTMENTS VEINTE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJO	O	ALTA	68,563	3,049,682.24	2.63
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	228,135	12,551,987.70	10.83
1	GMEXICO	B	ALTA	111,617	11,685,183.73	10.08
1	GFNORTE	O	ALTA	59,726	8,321,623.58	7.18
1	FEMSA	UBD	ALTA	39,085	7,591,479.55	6.55
1	AMX	B	ALTA	424,956	6,718,554.36	5.80
1	GENTERA	*	ALTA	213,064	5,441,654.56	4.70
1	CEMEX	CPO	ALTA	492,227	5,188,072.58	4.48
1	BOLSA	A	ALTA	155,826	5,098,626.72	4.40
1	MEGA	CPO	ALTA	112,989	4,960,217.10	4.28
1	HCITY	*	MEDIA	802,756	3,764,925.64	3.25
1	GRUMA	B	ALTA	10,838	3,746,046.32	3.23
1	GCC	*	ALTA	22,666	3,709,064.24	3.20
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	34,439	3,636,758.40	3.14
1	CUERVO	*	ALTA	130,331	3,427,705.30	2.96
1	ALSEA	*	ALTA	66,612	3,222,688.56	2.78
1	ASUR	B	ALTA	5,883	3,148,405.11	2.72
1	KIMBER	A	ALTA	105,218	3,022,913.14	2.61
1	GAP	B	ALTA	8,511	2,952,976.56	2.55
1	ALPEK	A	MEDIA	221,509	2,877,401.91	2.48
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,175,369	4,523,788.59	3.90
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN EN ENERGÍA						
FE	FCFE	18	MEDIA	93,388	2,353,377.60	2.03
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	DANHOS	13	ALTA	119,880	2,589,408.00	2.23
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					113,582,541.49	98.03
OTROS VALORES				22,904	2,286,652.43	1.97
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					115,869,193.92	100.00

	CATEGORÍA	
	RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
NA	1.545%	2.600%

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.