

**COMPASS**COLRVL COMPASS INVESTMENTS VEINTE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable  
CARTERA DE VALORES AL 29 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES DE BANCOS</b>						
41	BBAJO	O	ALTA	104,915	4,441,051.95	3.20
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	WALMEX	*	ALTA	281,864	15,192,469.60	10.96
1	GMEXICO	B	ALTA	122,857	12,074,385.96	8.71
1	GFNORTE	O	ALTA	72,851	9,858,925.83	7.11
1	FEMSA	UBD	ALTA	47,280	8,456,028.00	6.10
1	AMX	B	ALTA	513,510	7,810,487.10	5.64
1	GENEREA	*	ALTA	257,743	6,652,346.83	4.80
1	CEMEX	CPO	ALTA	594,121	6,618,507.94	4.78
1	BOLSA	A	ALTA	188,658	6,029,509.68	4.35
1	MEGA	CPO	ALTA	136,544	5,308,830.72	3.83
1	GCC	*	ALTA	27,359	4,952,526.18	3.57
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	47,251	4,817,239.45	3.48
1	GRUMA	B	ALTA	13,129	4,528,979.84	3.27
1	HCITY	*	MEDIA	972,065	4,520,102.25	3.26
1	ALSEA	*	ALTA	95,272	4,292,956.32	3.10
1	CUERVO	*	ALTA	157,637	4,128,513.03	2.98
1	GAP	B	ALTA	10,305	3,867,569.55	2.79
1	ALPEK	A	MEDIA	268,644	3,726,092.28	2.69
1	ASUR	B	ALTA	7,119	3,695,401.71	2.67
1	KIMBER	A	ALTA	127,133	3,475,816.22	2.51
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,422,585	5,080,916.25	3.67
<b>FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN EN ENERGÍA</b>						
FE	FCFE	18	MEDIA	113,103	2,827,575.00	2.04
<b>FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA</b>						
CF	DANHOS	13	ALTA	145,240	3,164,779.60	2.28
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>135,521,011.29</b>	<b>97.78</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDESF	270722	mxAAA	30,821	3,081,671.68	2.22
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>3,081,671.68</b>	<b>2.22</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>138,602,682.97</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b> RVESACC	
<b>CALIFICACIÓN</b> NA	<b>VaR Promedio</b> 1.545%	<b>Límite de VaR</b> 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.

---

 Iván Alejandro Ramil Flores