



COLRVL COMPASS INVESTMENTS VEINTE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 16 MAYO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	238,559	16,238,711.13	12.17
1	GFNORTE	O	ALTA	62,437	10,942,084.25	8.20
1	FEMSA	UBD	ALTA	53,285	10,722,007.70	8.03
1	AMX	B	ALTA	550,018	9,069,796.82	6.80
1	GMEXICO	B	ALTA	77,218	8,171,980.94	6.12
1	CEMEX	CPO	ALTA	510,149	6,657,444.45	4.99
1	GRUMA	B	ALTA	17,593	5,725,641.85	4.29
1	MEGA	CPO	ALTA	104,958	5,661,434.52	4.24
1	BOLSA	A	ALTA	161,883	5,126,834.61	3.84
1	CUERVO	*	ALTA	135,075	4,569,587.25	3.42
1	GENTERA	*	ALTA	169,106	4,464,398.40	3.35
1	KIMBER	A	ALTA	109,059	4,084,259.55	3.06
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	28,264	4,042,034.64	3.03
1	GCC	*	ALTA	19,138	3,817,648.24	2.86
1	ASUR	B	ALTA	6,091	3,608,552.04	2.70
1	HCITY	*	MEDIA	837,185	3,558,036.25	2.67
1	GAP	B	ALTA	8,859	2,871,822.03	2.15
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,101,588	14,826,477.91	11.11
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					124,158,752.58	93.03
REPORTO						
LF	BONDEF	261022	mxAAA	41,809	4,171,228.05	3.13
TOTAL REPORTO					4,171,228.05	3.13
OTROS VALORES				164,556	5,128,212.87	3.84
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					133,458,193.50	100.00

	CATEGORÍA	
	RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
NA	1.493%	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.