

**COMPASS**COLRVL COMPASS INVESTMENTS VEINTE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 19 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJO	O	ALTA	111,715	4,735,598.85	3.15
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	305,119	17,706,055.57	11.79
1	GMEXICO	B	ALTA	133,121	12,971,310.24	8.64
1	GFNORTE	O	ALTA	78,847	10,407,804.00	6.93
1	FEMSA	UBD	ALTA	51,176	8,808,924.88	5.86
1	AMX	B	ALTA	556,479	8,091,204.66	5.39
1	CEMEX	CPO	ALTA	644,000	7,302,960.00	4.86
1	BOLSA	A	ALTA	204,131	6,856,760.29	4.57
1	GENTERA	*	ALTA	279,222	6,712,496.88	4.47
1	GCC	*	ALTA	29,163	5,263,629.87	3.50
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	50,419	5,041,900.00	3.36
1	MEGA	CPO	ALTA	145,416	4,954,323.12	3.30
1	HCITY	*	MEDIA	1,034,033	4,642,808.17	3.09
1	GRUMA	B	ALTA	13,952	4,625,785.60	3.08
1	ALSEA	*	ALTA	101,188	4,367,274.08	2.91
1	CUERVO	*	ALTA	167,662	4,183,166.90	2.79
1	ASUR	B	ALTA	7,697	4,114,508.32	2.74
1	GAP	B	ALTA	11,149	4,084,547.64	2.72
1	ALPEK	A	MEDIA	285,009	3,859,021.86	2.57
1	KIMBER	A	ALTA	135,098	3,775,989.10	2.51
1	NEMAK	A	MEDIA	1,430,438	3,347,224.92	2.23
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN EN ENERGÍA						
FE	FCFE	18	MEDIA	122,321	3,117,962.29	2.08
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	DANHOS	13	ALTA	157,667	3,333,080.38	2.22
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					142,304,337.62	94.74
REPORTO						
LF	BONDESF	261001	mxAAA	49,220	4,937,387.92	3.29
TOTAL REPORTO					4,937,387.92	3.29
OTROS VALORES				104,817	2,955,756.11	1.97
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					150,197,481.65	100.00

CATEGORÍA
RVESACCCALIFICACIÓN
NAVaR Promedio
1.526%Límite de VaR
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.