

VINCI COMPASS

CRECE+ COMPASS INVESTMENTS DOCE, S.A. DE C.V., Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 16 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	GFNORTE	O	ALTA	468,763	67,309,679.17	12.73
1	WALMEX	*	ALTA	1,042,710	57,130,080.90	10.81
1	FEMSA	UBD	ALTA	333,319	56,480,904.55	10.68
1	AMX	B	ALTA	3,834,294	55,405,548.30	10.48
1	GMEXICO	B	ALTA	411,788	42,340,042.16	8.01
1	GAP	B	ALTA	90,825	35,794,132.50	6.77
1	KOF	UBL	ALTA	213,577	33,952,335.69	6.42
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,727,905	30,852,605.55	5.84
1	AC	*	ALTA	154,254	27,387,797.70	5.18
1	GRUMA	B	ALTA	83,695	27,274,526.60	5.16
1	OMA	B	ALTA	121,150	23,985,277.00	4.54
1	ALFA	A	ALTA	1,262,829	19,106,602.77	3.61
1	ALPEK	A	MEDIA	1,388,666	18,816,424.30	3.56
1	LAB	B	ALTA	657,166	17,152,032.60	3.24
1	GENTERA	*	ALTA	544,605	14,018,132.70	2.65
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					527,006,122.49	99.70
OTROS VALORES				15,882	1,608,422.40	0.30
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					528,614,544.89	100.00

	CATEGORÍA RVESACC
CALIFICACIÓN NA	VaR Promedio 1.749%
	Límite de VaR 3.800%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico de volatilidad estable, con un horizonte temporal de un día que utiliza los 320 datos más recientes para componer el 50% de la volatilidad y otros 1600 datos anteriores para componer el otro 50%.

Iván Alexandro Ramil Flores