

VINCI COMPASS

GLOBAL+ COMPASS INVESTMENTS DIECIOCHO, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 20 FEBRERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
56SP	MFPGEUS	ID	NA	1,125,862	499,710,494.76	53.75
56SP	GQGGEIU	ID	NA	430,035	217,682,628.15	23.41
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	530731	mxAAA	2,040,584	166,103,531.48	17.87
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	VWRA	N	ALTA	15,615	46,087,116.14	4.96
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					929,583,770.53	99.98
OTROS VALORES				7,800	158,441.03	0.02
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					929,742,211.56	100.00

	CATEGORÍA RVESACC	
CALIFICACIÓN N/A	VaR Promedio 0.856%	Límite de VaR 2.800%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico de volatilidad estable. Un modelo paramétrico lineal calcula el VAR usando formulas analíticas basadas en una distribución paramétrica para los rendimientos de los factores de riesgo, cuando el valor de la cartera es una función lineal de sus factores de riesgo.

Iván Alejandro Ramil Flores