



IDEA COMPASS INVESTMENTS SEIS, S.A. DE C.V, FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 04 OCTUBRE, 2018

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	GMEXICO	B	ALTA	50,000	2,675,500.00	1.39
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	OBSV	N	NA	15,000	5,035,417.80	2.62
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	BAC	*	ALTA	7,000	4,072,112.17	2.12
1ASP	JPM	*	ALTA	2,500	5,509,041.48	2.87
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	370,000	17,993,100.00	9.37
1ISP	EWJ	*	ALTA	5,000	5,654,808.60	2.95
1ISP	FEZ	*	ALTA	9,200	6,634,057.81	3.46
1ISP	IWM	*	ALTA	2,000	6,256,611.76	3.26
1ISP	QQQ	*	NA	1,810	6,310,670.81	3.29
1ISP	SHV	*	ALTA	22,008	46,406,181.04	24.17
1ISP	SHY	*	ALTA	10,115	16,030,244.92	8.35
1ISP	SPY	*	ALTA	1,500	8,299,836.72	4.32
1ISP	XBI	*	NA	1,070	1,878,604.65	0.98
1ISP	XLE	*	ALTA	2,500	3,688,147.23	1.92
1ISP	XLF	*	ALTA	8,000	4,303,619.04	2.24
1ISP	XLK	*	ALTA	1,530	2,180,806.19	1.14
1ISP	XLP	*	ALTA	5,000	5,112,841.65	2.66
1ISP	XLV	*	ALTA	2,000	3,609,289.60	1.88
1ISP	XRT	*	NA	5,000	4,653,077.80	2.42
1ISP	XSD	*	NA	3,100	4,402,033.36	2.29
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	GOOGL	*	NA	310	6,975,634.63	3.63
1ASP	SHOP	N	NA	2,000	5,693,424.94	2.97
1ASP	STM	N	ALTA	16,550	5,777,214.75	3.01
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	350,000	5,148,500.00	2.68
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					184,300,776.95	96.01
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					184,300,776.95	96.01
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IM	BPAG28	201112	mxAAA	76,595	7,664,662.95	3.99
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					7,664,662.95	3.99
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					191,965,439.90	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
0.784%

Límite de VaR
5.000%

El Fondo de inversión no se encuentra en una estrategia temporal de inversión

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico lineal, 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%.

Jose Ignacio Armendariz Morales