



I-CORP COMPASS INVESTMENTS NUEVE, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 10 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
TÍTULOS BANCARIOS						
94	COMPART	16-2	mxAA	150,000	15,329,750.85	1.45
PAPEL PRIVADO						
91	ABCCB	18	mxAAA	300,000	21,009,548.70	1.99
91	AERMXCB	17	HR BB-	15,000	1,138,378.31	0.11
91	ALSEA	19-2	A-(mex)	200,000	21,362,974.40	2.02
91	ARA	17	mxA+	311,677	24,047,269.07	2.28
91	ARRENCB	21	mxAAA	200,000	20,013,624.60	1.90
91	ATLASCB	19	HR AAA	270,000	27,080,060.67	2.57
91	AUTLNCB	17	HR AA	514,122	11,470,356.41	1.09
91	AXO	16-2	HR A-	115,000	11,505,635.58	1.09
91	AXO	18	HR A-	237,082	23,965,097.08	2.27
91	AXO	19	HR A-	89,377	9,104,022.73	0.86
91	DESCB	18	AA(mex)	379,923	22,960,471.36	2.18
91	DONDE	20	HR AA+	240,000	24,041,112.48	2.28
91	FIBRAHD	19	HR AA	200,000	19,919,582.00	1.89
91	FINN	18	A(mex)	59,000	6,442,342.63	0.61
91	FSHOP	17	A+(mex)	123,400	12,369,917.59	1.17
91	FSHOP	17-2	A+(mex)	100,000	10,441,753.30	0.99
91	FSHOP	19	A+(mex)	167,137	16,686,663.58	1.58
91	FUNO	18	AAA(mex)	460,000	45,813,059.22	4.34
91	GICSA	17	mxBBB-	300,000	27,527,770.50	2.61
91	GISSA	17	AA-(mex)	50,000	5,319,970.65	0.50
91	ITTO	17	HR BBB-	250,000	24,962,080.50	2.36
91	LAB	20	AA(mex)	222,824	22,293,679.57	2.11
91	LALA	18	HR AA-	30,390	3,212,637.88	0.30
91	LALA	19-2	HR AA-	129,700	12,755,615.50	1.21
91	MERCFCB	19	mxAA+	60,000	3,143,772.90	0.30
91	MOLYMET	13	mxAA	300,000	30,092,137.20	2.85
91	MONTPIO	17	HR AA+	349,293	35,102,306.57	3.33
91	MONTPIO	19	HR AA+	100,000	10,096,321.90	0.96
91	MTPCB	17	Aaa.mx	200,000	20,591,270.20	1.95
91	OMA	21V	Aaa.mx	125,000	12,548,997.88	1.19
91	RCENTRO	16	HR C	100,000	3,236,523.00	0.31
91	RCENTRO	17	HR C	300,000	8,328,554.70	0.79
91	RUBA	17	mxA+	462,879	27,130,095.46	2.57
91	SALUD	20	HR AA-	185,000	18,643,000.75	1.77
91	TIPMXCB	20	AAA(mex)	250,000	24,143,089.25	2.29
91	TIPMXCB	20-2	AAA(mex)	200,000	20,193,833.80	1.91
91	TRAXION	20	A(mex)	200,000	19,708,402.80	1.87
91	UNFINCB	17-3	mxAA+	165,000	11,407,512.11	1.08
91	UNFINCB	17-4	mxAA+	126,001	8,851,340.17	0.84
91	VASCONI	19	A-(mex)	207,907	20,831,311.10	1.97
91	VINTE	19X	HR A+	223,500	22,365,463.74	2.12
91	VIVAACB	19	HR A+	200,000	19,810,598.80	1.88
91	VOLARCB	19	HR AA	380,000	38,030,840.42	3.60
93	ABNGOA	00915	HR D	99,800	0.10	0.00
93	AUTLAN	00121	F2(mex)	150,000	15,053,193.60	1.43
93	AUTLAN	00221	F2(mex)	100,000	10,011,594.30	0.95
93	AUTLAN	00320	F2(mex)	100,000	10,030,566.70	0.95
93	GFMGA	00220	mxA-2	19,250	1,925,320.44	0.18
93	NAVISTS	00121	HR2	100,000	10,029,729.10	0.95
93	VASCONI	00121	F2(mex)	50,000	5,002,471.40	0.47
95	CFE	14-2	mxAAA	360,000	35,251,775.28	3.34
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					882,333,398.83	83.59
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					882,333,398.83	83.59
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	240425	mxAAA	1,741,044	173,223,299.44	16.41
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					173,223,299.44	16.41
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,055,556,698.27	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AAI/S5

VaR Promedio
0.073%

Límite de VaR
0.500%

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