



STRAT COMPASS INVESTMENTS DIECINUEVE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable  
CARTERA DE VALORES AL 27 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ASP	GOOG	*	ALTA	35,977	123,756,144.28	6.32
1ASP	MSFT	*	ALTA	13,400	111,708,096.07	5.71
1ASP	AMZN	*	ALTA	30,164	109,862,750.10	5.61
1ASP	COST	*	ALTA	6,671	104,460,478.24	5.34
1ASP	META	*	ALTA	8,939	85,496,852.11	4.37
1ASP	TCEHY	N	ALTA	70,117	61,376,105.40	3.14
1ASP	LULU	*	ALTA	10,113	57,395,654.33	2.93
1ASP	BABA	N	ALTA	42,500	56,620,406.38	2.89
1ASP	AAPL	*	ALTA	13,887	54,733,167.50	2.80
1ASP	TSM	N	ALTA	16,998	53,705,220.84	2.74
1ASP	SPGI	*	ALTA	6,147	50,798,158.93	2.60
1ASP	MA	*	ALTA	5,719	46,612,687.77	2.38
1ASP	V	*	ALTA	9,176	45,032,155.88	2.30
1ASP	EW	*	ALTA	26,161	44,951,854.85	2.30
1ASP	WTS	*	ALTA	13,147	44,495,467.75	2.27
1ASP	CDNS	*	ALTA	7,821	44,332,851.22	2.27
1ASP	BRKB	*	ALTA	5,722	42,971,475.91	2.20
1ASP	CPRT	*	ALTA	41,768	42,104,896.01	2.15
1ASP	AMAT	*	ALTA	9,727	41,637,379.31	2.13
1ASP	PG	*	ALTA	13,363	40,987,985.88	2.09
1ASP	MC	N	ALTA	2,842	40,064,961.01	2.05
1ASP	ADBE	*	ALTA	3,961	39,868,239.33	2.04
OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				632,812	383,192,623.86	19.58
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ISP	SHV	*	ALTA	66,668	135,552,841.67	6.93
1ISP	CNYAU	*	ALTA	86,035	40,022,654.00	2.05
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>1,901,741,108.63</b>	<b>97.17</b>
<b>OTROS VALORES</b>				453,147	<b>55,303,495.35</b>	<b>2.83</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>1,957,044,603.98</b>	<b>100.00</b>

CATEGORÍA	VaR Promedio	Limite de VaR
RVDIS	1.366%	4.600%
CALIFICACIÓN		
NA		

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

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%.