



I-CORP COMPASS INVESTMENTS NUEVE, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 JULIO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270114	mxAAA	400,000	39,938,596.00	2.63
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	360221	mxAAA	450,000	42,277,635.00	2.78
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	COMPART	22S	mxAA	400,000	40,167,153.20	2.64
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	CMPC	25V	AAA(mex)	850,000	85,168,748.80	5.60
91	LAB	23-2	AA+(mex)	827,693	83,390,203.01	5.48
91	MOLYMET	25	AAA(mex)	750,000	75,373,017.00	4.95
91	EDUCA	23L	AA+(mex)	740,000	74,552,786.66	4.90
91	GAP	24	mxAAA	600,000	60,907,665.00	4.00
91	CEMEX	23L	mxAAA+	600,000	60,378,925.20	3.97
91	SITES1	25	AAA(mex)	596,544	59,963,935.35	3.94
91	MONTPIO	21	HR AA+	570,000	57,217,349.55	3.76
91	INVTACB	25	AA.mx	500,000	50,431,757.50	3.32
91	FERROMX	25	mxAAA	500,000	50,294,108.50	3.31
91	OMA	25	AAA.mx	500,000	50,081,974.50	3.29
91	FUNO	23-2L	AAA(mex)	500,000	50,066,568.00	3.29
91	MEGA	24X	AAA(mex)	450,000	45,191,314.80	2.97
91	VIVAACB	22L	HR AAA	422,547	42,807,899.80	2.81
91	NM	24	mxAAA+	400,000	40,229,879.60	2.64
91	NM	25	mxAAA+	400,000	40,173,352.00	2.64
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				1,304,571	112,763,151.55	7.41
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	CFE	23-2X	mxAAA	483,810	48,578,850.23	3.19
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	5,000,000	48,442,960.00	3.18
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	C537	290921	A	12	31,525,987.13	2.07
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	20	50,621,573.72	3.33
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,340,545,392.10	88.12
REPORTO						
LF	BONDES F	290719	mxAAA	588,778	58,433,009.96	3.84
TOTAL REPORTO					58,433,009.96	3.84
OTROS VALORES				1,279,038	122,307,016.02	8.04
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,521,285,418.08	100.00

CATEGORÍA IDDIS		
CALIFICACIÓN AAA+/S5	VaR Promedio 0.060%	Límite de VaR 0.500%

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%.