



I+CORP COMPASS INVESTMENTS NUEVE, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
CARTERA DE VALORES AL 27 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDEF	250424	mxAAA	1,150,000	115,209,474.80	7.69
LF	BONDEF	250116	mxAAA	506,440	50,964,898.11	3.40
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA</b>						
M	BONOS	341123	mxAAA	400,000	34,631,946.40	2.31
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS</b>						
94	COMPART	22S	mxAA	400,000	40,660,414.00	2.71
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
91	LAB	23-2	AA+(mex)	827,693	82,999,531.91	5.54
91	CMPC	23V	AAA(mex)	800,000	80,749,777.60	5.39
91	EDUCA	23L	AA+.mx	740,000	74,161,239.34	4.95
91	CEMEX	23L	mxAA+	600,000	60,292,016.40	4.02
91	MONTPIO	21	HR AA+	570,000	57,142,028.61	3.81
91	FUNO	23-2L	AAA(mex)	500,000	50,474,490.50	3.37
91	MOLYMET	23	AAA(mex)	500,000	50,150,149.00	3.35
91	ORBA	22L	AAA(mex)	500,000	50,148,924.00	3.35
91	MEGA	24X	AAA(mex)	450,000	45,146,015.10	3.01
91	SALUD	21	HR A+	440,000	44,001,819.84	2.94
91	VIVAACB	22L	HR AA+	422,547	42,713,875.06	2.85
91	NM	24	mxAA+	400,000	40,157,418.40	2.68
91	GHEMA	23	HR A-	385,000	38,755,008.22	2.59
91	HERDEZ	20-2	mxAA	300,000	30,065,959.20	2.01
91	DAFCB	24	AAA.mx	300,000	30,012,826.50	2.00
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				2,366,601	219,803,189.58	14.67
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES				375,062	37,822,629.86	2.52
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>						
BI	CETES	251224	mxAAA	5,000,000	42,641,520.00	2.85
<b>TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>						
D8	GSF0325	FLOAT	A2	20	50,230,527.32	3.35
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>1,368,935,679.75</b>	<b>91.36</b>
<b>REPORTO</b>						
LD	BONDESD	250814	mxAAA	744,699	74,511,768.00	4.97
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>74,511,768.00</b>	<b>4.97</b>
<b>OTROS VALORES</b>				250,012	<b>55,007,257.36</b>	<b>3.67</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>1,498,454,705.11</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b>		
	IDDIS		
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Límite de VaR</b>	
AA/S5	0.059%	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%.