

**COMPASS**I+CORP COMPASS INVESTMENTS NUEVE, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	250424	mxAAA	1,150,000	115,316,122.35	7.66
LF	BONDES F	250116	mxAAA	506,440	51,012,095.79	3.39
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	500,000	50,348,988.50	3.35
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	COMPART	22S	mxAA	400,000	40,329,935.60	2.68
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	LAB	23-2	AA+(mex)	827,693	83,081,917.99	5.52
91	CMPC	23V	AAA(mex)	800,000	80,079,684.80	5.32
91	EDUCA	23L	AA+.mx	740,000	74,237,512.62	4.93
91	CEMEX	23L	mxAA+	600,000	60,350,438.40	4.01
91	MONTPIO	21	HR AA+	570,000	57,202,725.06	3.80
91	MOLYMET	23	AAA(mex)	500,000	50,200,435.00	3.34
91	ORBITA	22L	AAA(mex)	500,000	50,197,142.00	3.34
91	FUNO	23-2L	AAA(mex)	500,000	50,050,469.00	3.33
91	MEGA	24X	AAA(mex)	450,000	45,189,733.50	3.00
91	SALUD	21	HR A+	440,000	44,051,623.00	2.93
91	VIVAACB	22L	HR AA+	422,547	42,760,446.93	2.84
91	NM	24	mxAA+	400,000	40,196,392.80	2.67
91	GHEMA	23	HR A-	385,000	38,800,094.03	2.58
91	HERDEZ	20-2	mxAA	300,000	30,095,867.70	2.00
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				2,666,601	250,181,173.83	16.63
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL				375,062	37,859,476.27	2.52
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	5,000,000	42,692,480.00	2.84
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSF0325	FLOAT	A2	20	50,279,898.79	3.34
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,384,514,653.96	92.02
REPORTO						
LF	BONDES F	290419	mxAAA	653,493	64,908,944.01	4.31
TOTAL REPORTO					64,908,944.01	4.31
OTROS VALORES				250,012	55,115,228.08	3.66
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,504,538,826.05	100.00

CATEGORÍA
IDDISCALIFICACIÓN
AAAf/S5VaR Promedio
0.057%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%.

Iván Alejandro Ramil Flores