



I+CORP COMPASS INVESTMENTS NUEVE, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 09 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	211216	mxAAA	3,500,000	34,545,647.50	2.87
BI	CETES	220602	mxAAA	3,500,000	33,700,348.50	2.80
TÍTULOS BANCARIOS						
94	COMPART	16-2	mxAA	150,000	15,448,547.10	1.28
PAPEL PRIVADO						
91	ABCCB	18	mxAAA	393,105	21,095,032.05	1.75
91	AERMXCB	17	HR BB-	15,000	1,154,193.80	0.10
91	ALSEA	19-2	A-(mex)	200,000	21,410,046.40	1.78
91	ARA	17	mxA+	311,677	20,467,226.74	1.70
91	ARRENCB	21	mxAAA	200,000	20,014,681.80	1.66
91	ATLASCB	19	HR AAA	270,000	27,080,084.97	2.25
91	AXO	16-2	A(mex)	115,000	11,157,747.47	0.93
91	DESCB	18	AA(mex)	379,923	14,829,354.76	1.23
91	DHIC	15	AA+(mex)	300,000	30,130,452.00	2.50
91	DONDE	20	HR AA+	240,000	24,075,516.72	2.00
91	FIBRAHD	19	HR AA	200,000	19,958,846.40	1.66
91	FINN	18	BBB+(mex)	59,000	6,024,253.76	0.50
91	FSHOP	17	A+(mex)	173,400	17,394,737.70	1.44
91	FSHOP	17-2	A+(mex)	50,000	4,992,050.85	0.41
91	FSHOP	19	A+(mex)	167,137	16,729,015.93	1.39
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	115,000	11,505,332.55	0.96
91	FUNO	18	AAA(mex)	560,000	55,901,907.60	4.64
91	GICSA	17	mxB	300,000	26,432,013.60	2.19
91	GISSA	17	AA-(mex)	50,000	5,315,460.05	0.44
91	GPH	19	AAA(mex)	448,631	44,812,894.15	3.72
91	GRUMA	18	mxAA+	45,000	4,511,293.16	0.37
91	ITTO	17	HR BBB-	250,000	24,896,863.75	2.07
91	LAB	20	AA(mex)	422,824	42,819,089.66	3.56
91	LALA	18	HR AA-	30,390	3,064,535.02	0.25
91	LALA	18-2	HR AA-	40,000	3,997,506.52	0.33
91	LALA	19-2	HR AA-	129,700	12,785,399.03	1.06
91	LIVEPOL	17-2	mxAAA	80,091	8,028,796.70	0.67
91	MERCFCB	19	mxAA+	60,000	2,033,399.70	0.17
91	MOLYMET	13	mxAA	300,000	29,404,911.00	2.44
91	MONTPIO	17	HR AA+	389,293	39,151,334.82	3.25
91	MONTPIO	19	HR AA+	150,000	15,081,167.55	1.25
91	MTPCB	17	Aaa.mx	200,000	20,357,194.40	1.69
91	OMA	21V	Aaa.mx	125,000	12,513,384.13	1.04
91	RCENTRO	16	HR C	100,000	2,998,850.50	0.25
91	RCENTRO	17	HR C	300,000	8,374,482.00	0.70
91	RUBA	17	mxA+	462,879	19,302,442.66	1.60
91	SALUD	20	HR AA-	185,000	19,047,780.38	1.58
91	SALUD	21	HR AA-	150,000	15,077,230.35	1.25
91	TIPMXCB	20-2	AAA(mex)	200,000	20,147,773.80	1.67
91	TRAXION	20	A(mex)	200,000	18,849,026.40	1.56
91	UNFINCB	17-3	mxAA+	165,000	8,072,401.10	0.67
91	UNFINCB	17-4	mxAA+	126,001	6,233,335.24	0.52
91	VASCONI	19	A-(mex)	207,907	20,862,033.72	1.73
91	VINTE	19X	HR A+	223,500	22,397,335.74	1.86
91	VIVAACB	19	HR A+	276,499	27,413,294.00	2.28
91	VOLARCB	19	HR AA	380,000	35,789,957.24	2.97
93	ABNGOA	00915	HR D	99,800	0.10	0.00
93	AUTLAN	00121	F2(mex)	150,000	15,019,610.25	1.25
93	AUTLAN	00221	F2(mex)	100,000	10,036,119.60	0.83
93	AUTLAN	00321	F2(mex)	154,347	15,497,364.88	1.29
93	MINSA	00421	MX-2	150,000	15,002,244.90	1.25
93	VASCONI	00121	F2(mex)	50,000	5,007,488.80	0.42
95	CFE	21-2	mxAAA	320,000	32,306,044.48	2.68
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,020,255,083.98	84.71
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,020,255,083.98	84.71
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	220505	mxAAA	19,061,925	184,223,428.59	15.29
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					184,223,428.59	15.29
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,204,478,512.57	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AAf/SS

VaR Promedio
0.029%

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%.