



**STRAT COMPASS INVESTMENTS DIECINUEVE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANSAN	0801476		68,718	1,350,022.89	0.08
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,350,022.89	0.08
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1ASP	TOT	N	ALTA	41,042	43,016,260.97	2.55
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AGUA	*	MEDIA	669,337	11,438,969.33	0.68
1ASP	DAL	*	ALTA	44,296	47,592,898.21	2.82
1ASP	UAL	*	NA	28,124	45,836,933.03	2.72
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	AMZN	*	ALTA	2,467	85,027,142.63	5.05
1ASP	DAI	N	ALTA	41,929	43,934,259.46	2.61
1ASP	VOW3	N	NA	16,252	50,970,790.04	3.02
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	BAC	*	ALTA	63,726	34,904,317.23	2.07
1ASP	GS	*	ALTA	15,216	56,739,996.84	3.37
1ASP	JPM	*	ALTA	22,257	48,260,007.70	2.86
1ASP	MA	*	NA	8,775	44,447,802.29	2.64
1ASP	V	*	ALTA	12,582	41,259,862.41	2.45
1ISP	AAXJ	*	ALTA	130,108	169,263,335.93	10.04
1ISP	HACK	*	NA	89,100	67,339,456.81	4.00
1ISP	IBB	*	ALTA	18,894	37,924,251.93	2.25
1ISP	ICLN	*	NA	507,487	101,992,978.31	6.05
1ISP	SHV	*	ALTA	167,202	362,906,587.86	21.54
1ISP	SX7EEX	N	NA	492,442	94,550,568.83	5.61
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	AAPL	*	ALTA	16,808	61,160,867.64	3.63
1ASP	BABA	N	NA	15,918	47,377,359.43	2.81
1ASP	FB	*	NA	21,221	70,177,369.82	4.16
1ASP	GOOG	*	ALTA	2,862	58,719,352.84	3.48
1ASP	TCEHY	N	NA	61,916	51,222,155.65	3.04
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,676,063,525.19	99.46
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,676,063,525.19	99.46
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	191003	mxAAA	77,366	7,774,731.17	0.46
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					7,774,731.17	0.46
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,685,188,279.25	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.097%

Límite de VaR
4.600%

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%.