



STRAT COMPASS INVESTMENTS DIECINUEVE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 20 JUNIO, 2024

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|---|---------|-------|-----------------------|---------------|-------------------------|--------------------------|
| DIRECTO | | | | | | |
| ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | | |
| 1ASP | GOOG | * | ALTA | 35,977 | 117,451,929.03 | 6.03 |
| 1ASP | MSFT | * | ALTA | 13,400 | 109,716,204.03 | 5.63 |
| 1ASP | COST | * | ALTA | 6,671 | 105,692,257.10 | 5.42 |
| 1ASP | AMZN | * | ALTA | 30,164 | 103,123,737.86 | 5.29 |
| 1ASP | META | * | ALTA | 8,939 | 82,386,561.85 | 4.23 |
| 1ASP | TCEHY | N | ALTA | 70,117 | 63,464,261.32 | 3.26 |
| 1ASP | BABA | N | ALTA | 42,500 | 58,048,799.68 | 2.98 |
| 1ASP | LULU | * | ALTA | 10,113 | 57,735,434.16 | 2.96 |
| 1ASP | TSM | N | ALTA | 16,998 | 54,764,765.40 | 2.81 |
| 1ASP | AAPL | * | ALTA | 13,887 | 53,491,993.65 | 2.74 |
| 1ASP | SPGI | * | ALTA | 6,147 | 49,540,922.35 | 2.54 |
| 1ASP | MA | * | ALTA | 5,719 | 47,541,361.90 | 2.44 |
| 1ASP | V | * | ALTA | 9,176 | 46,663,166.94 | 2.39 |
| 1ASP | CDNS | * | ALTA | 7,821 | 45,765,263.63 | 2.35 |
| 1ASP | WTS | * | ALTA | 13,147 | 45,026,252.60 | 2.31 |
| 1ASP | BRKB | * | ALTA | 5,722 | 43,008,445.92 | 2.21 |
| 1ASP | AMAT | * | ALTA | 9,727 | 42,884,011.38 | 2.20 |
| 1ASP | EW | * | ALTA | 26,161 | 42,695,905.80 | 2.19 |
| 1ASP | CPRT | * | ALTA | 41,768 | 41,442,046.96 | 2.13 |
| 1ASP | PG | * | ALTA | 13,363 | 41,160,692.58 | 2.11 |
| 1ASP | MC | N | ALTA | 2,842 | 39,884,965.02 | 2.05 |
| OTROS TIPO DE VALOR 1ASP - ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | 636,773 | 425,210,308.77 | 21.81 |
| TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | | |
| 1ISP | SHV | * | ALTA | 66,668 | 135,136,836.28 | 6.93 |
| 1ISP | CNYAU | * | ALTA | 86,035 | 40,650,834.77 | 2.09 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 1,892,486,958.98 | 97.09 |
| OTROS VALORES | | | | 446,914 | 56,689,880.16 | 2.91 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 1,949,176,839.14 | 100.00 |

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.366%

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%.