

VINCI COMPASS

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 28 FEBRERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	250828	mxAAA	400,000	40,173,430.80	4.02
LF	BONDES F	260604	mxAAA	400,000	40,132,995.20	4.01
LF	BONDES F	261001	mxAAA	258,692	25,890,503.80	2.59
LF	BONDES F	251002	mxAAA	200,000	20,047,664.80	2.00
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				300,000	29,950,144.20	2.99
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	2,350,000	213,712,710.65	21.36
M	BONOS	330526	mxAAA	1,220,000	110,939,761.82	11.09
M	BONOS	421113	mxAAA	1,300,000	108,810,022.10	10.88
M	BONOS	270603	mxAAA	225,000	22,278,748.05	2.23
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE IN				250,000	24,155,422.50	2.41
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	281130	mxAAA	62,294	50,691,947.88	5.07
S	UDIBONO	261203	mxAAA	39,162	31,678,615.97	3.17
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	1,000,000	100,461,344.00	10.04
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	10,000,000	91,790,430.00	9.18
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					910,713,741.77	91.04
REPORTO						
BI	CETES	250515	mxAAA	7,269,074	71,347,548.35	7.13
TOTAL REPORTO					71,347,548.35	7.13
OTROS VALORES				22,748	18,259,029.67	1.83
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,000,320,319.79	100.00

CATEGORÍA IDDISGUB

CALIFICACIÓN
AAA+/S5

VaR Promedio
0.340%

Límite de VaR
0.950%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo histórico calcula el VaR considerando los últimos 1,000 escenarios de valuación para los instrumentos contenidos en el portafolio del fondo.
Tomando en cuenta estos escenarios, se valúa la posición actual para tener un vector de 1,000 elementos que contiene la pérdida o ganancia que tendría el portafolio dados esos escenarios.
Posteriormente se ordenan los montos de menor a mayor y se determina el escenario de acuerdo con el nivel de confianza, en este caso se toma el escenario 51 correspondiente al nivel de confianza del 95%.