

VINCI COMPASS

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 23 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDEF	250828	mxAAA	400,000	40,068,758.40	4.10
LF	BONDEF	260604	mxAAA	400,000	40,021,604.80	4.10
LF	BONDEF	261001	mxAAA	258,692	25,813,677.19	2.64
LF	BONDEF	251002	mxAAA	200,000	19,993,392.80	2.05
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	2,350,000	204,861,571.95	20.98
M	BONOS	330526	mxAAA	1,970,000	172,764,431.57	17.69
M	BONOS	421113	mxAAA	1,300,000	103,646,108.80	10.62
M	BONOS	270603	mxAAA	225,000	21,807,004.28	2.23
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INT				250,000	23,503,792.45	2.41
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	39,162	31,178,341.55	3.19
OTROS TIPO DE VALOR S - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREG				35,499	27,899,776.98	2.86
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	1,000,000	100,199,557.00	10.26
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	10,000,000	90,461,480.00	9.26
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					902,219,497.77	92.40
REPORTO						
IQ	BPAG91	290913	mxAAA	640,700	64,182,884.75	6.57
TOTAL REPORTO					64,182,884.75	6.57
OTROS VALORES				100,000	9,992,273.40	1.02
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					976,394,655.92	100.00

	CATEGORÍA IDDISGUB	
CALIFICACIÓN AAA/S5	VaR Promedio 0.389%	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%.

Iván Alejandro Ramil Flores