

VINCI COMPASS

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 21 AGOSTO, 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	271202	mxAAA	500,000	49,904,236.50	4.60
LF	BONDES F	270819	mxAAA	500,000	49,861,087.50	4.60
LF	BONDES F	250828	mxAAA	400,000	40,191,698.00	3.71
LF	BONDES F	260604	mxAAA	400,000	40,170,505.60	3.71
LF	BONDES F	261001	mxAAA	258,692	25,929,315.62	2.39
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				500,000	50,043,322.30	4.62
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	2,350,000	220,123,938.35	20.31
M	BONOS	421113	mxAAA	1,500,000	128,201,163.00	11.83
M	BONOS	330526	mxAAA	1,220,000	114,372,869.88	10.55
M	BONOS	471107	mxAAA	600,000	51,565,103.40	4.76
M	BONOS	360221	mxAAA	300,000	28,770,235.50	2.65
M	BONOS	270603	mxAAA	225,000	22,720,254.30	2.10
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE IN				250,000	24,856,720.40	2.29
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	281130	mxAAA	62,294	52,721,030.04	4.86
S	UDIBONO	261203	mxAAA	39,162	33,159,056.90	3.06
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	10,000,000	96,221,930.00	8.88
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,028,812,467.29	94.92
REPORTO						
IS	BPA182	320324	mxAAA	354,399	36,213,730.35	3.34
TOTAL REPORTO					36,213,730.35	3.34
OTROS VALORES				22,748	18,883,315.78	1.74
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,083,909,513.42	100.00

CATEGORÍA
IDDISGUB

CALIFICACIÓN
AAAf.mx MRA1.mx

VaR Promedio
0.431%

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 Alexandro Ramil Flores