

# VINCI COMPASS

I+CORP COMPASS INVESTMENTS NUEVE, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
CARTERA DE VALORES AL 16 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	250424	mxAAA	950,000	95,375,948.25	6.10
LF	BONDES F	251002	mxAAA	500,000	50,277,078.00	3.21
LF	BONDES F	270114	mxAAA	400,000	39,889,426.00	2.55
<b>BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL</b>						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	500,000	50,002,481.50	3.20
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS</b>						
94	COMPART	22S	mxAA	400,000	40,439,935.20	2.58
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
91	LAB	23-2	AA+(mex)	827,693	83,202,882.84	5.32
91	CMPC	23V	AAA(mex)	800,000	80,171,762.40	5.12
91	EDUCA	23L	AA+.mx	740,000	74,747,832.90	4.78
91	GAP	24	mxAAA	600,000	60,616,431.00	3.87
91	CEMEX	23L	mxAA+	600,000	60,437,950.20	3.86
91	MONTPIO	21	HR AA+	570,000	57,261,400.29	3.66
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	500,000	50,234,672.00	3.21
91	MOLYMET	24	AAA(mex)	500,000	50,137,326.50	3.20
91	FUNO	23-2L	AAA(mex)	500,000	50,015,493.00	3.20
91	MEGA	24X	AAA(mex)	450,000	45,235,233.90	2.89
91	VIVAACB	22L	HR AAA	422,547	43,169,734.82	2.76
91	NM	24	mxAA+	400,000	40,245,228.80	2.57
91	GHEMA	23	HR BBB+	385,000	38,755,298.51	2.48
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				2,301,601	218,779,526.34	13.98
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES				368,810	37,027,521.31	2.37
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>						
BI	CETES	251224	mxAAA	5,000,000	45,717,200.00	2.92
<b>TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>						
D8	GSF0325	FLOAT	A2	20	50,251,094.98	3.21
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>1,361,991,458.74</b>	<b>87.05</b>
<b>REPORTO</b>						
IQ	BPAG91	290913	mxAAA	1,170,451	117,209,485.76	7.49
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>117,209,485.76</b>	<b>7.49</b>
<b>OTROS VALORES</b>				550,012	85,468,137.98	5.46
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>1,564,669,082.48</b>	<b>100.00</b>

CATEGORÍA  
IDDIS

CALIFICACIÓN  
AAA/S5

VaR Promedio  
0.015%

Límite de VaR  
0.500%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico lineal, 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%.