

VINCI COMPASS

I-CORP COMPASS INVESTMENTS NUEVE, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 2025

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|--|---------|--------|-----------------------|---------------|-------------------------|--------------------------|
| DIRECTO | | | | | | |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F | | | | | | |
| LF | BONDEF | 250424 | mxAAA | 950,000 | 95,019,699.20 | 6.02 |
| LF | BONDEF | 251002 | mxAAA | 500,000 | 50,083,302.50 | 3.17 |
| LF | BONDEF | 251218 | mxAAA | 400,000 | 40,134,415.20 | 2.54 |
| LF | BONDEF | 270114 | mxAAA | 400,000 | 40,060,591.60 | 2.54 |
| BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL | | | | | | |
| IM | BPAG28 | 250508 | mxAAA | 500,000 | 50,193,031.00 | 3.18 |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS | | | | | | |
| 94 | COMPART | 22S | mxAA | 400,000 | 40,320,711.20 | 2.56 |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS | | | | | | |
| 91 | LAB | 23-2 | AA+(mex) | 827,693 | 83,715,549.26 | 5.31 |
| 91 | CMPC | 23V | AAA(mex) | 800,000 | 80,492,857.60 | 5.10 |
| 91 | EDUCA | 23L | AA+.mx | 740,000 | 74,377,064.78 | 4.71 |
| 91 | GAP | 24 | mxAAA | 600,000 | 60,526,425.00 | 3.84 |
| 91 | CEMEX | 23L | mxAA+ | 600,000 | 60,212,992.80 | 3.82 |
| 91 | MONTPIO | 21 | HR AA+ | 570,000 | 57,502,680.72 | 3.65 |
| 91 | FUNO | 23-2L | AAA(mex) | 500,000 | 50,226,178.50 | 3.18 |
| 91 | ORBIA | 22L | AAA(mex) | 500,000 | 50,021,084.50 | 3.17 |
| 91 | MEGA | 24X | AAA(mex) | 450,000 | 45,046,544.85 | 2.86 |
| 91 | VIVAACB | 22L | HR AAA | 422,547 | 42,808,686.16 | 2.71 |
| 91 | NM | 24 | mxAA+ | 400,000 | 40,074,536.80 | 2.54 |
| OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS | | | | 2,301,601 | 211,794,083.26 | 13.43 |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL | | | | | | |
| OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES | | | | 368,810 | 37,288,282.73 | 2.36 |
| CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO | | | | | | |
| BI | CETES | 251224 | mxAAA | 5,000,000 | 46,923,310.00 | 2.97 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 1,256,822,027.66 | 79.67 |
| REPORTO | | | | | | |
| IQ | BPAG91 | 290510 | mxAAA | 1,117,241 | 112,484,269.97 | 7.13 |
| IM | BPAG28 | 270506 | mxAAA | 680,546 | 68,081,124.68 | 4.32 |
| TOTAL REPORTO | | | | | 180,565,394.65 | 11.45 |
| OTROS VALORES | | | | 1,098,246 | 140,204,355.63 | 8.89 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 1,577,591,777.94 | 100.00 |

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN
AAA/S5

VaR Promedio
0.014%

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%.