

VINCI COMPASS

I-LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, 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 | BONDEF | 250703 | mxAAA | 11,500,000 | 1,155,144,962.00 | 20.21 |
| LF | BONDEF | 251002 | mxAAA | 8,647,941 | 866,855,111.89 | 15.16 |
| LF | BONDEF | 260604 | mxAAA | 5,500,000 | 551,828,684.00 | 9.65 |
| LF | BONDEF | 250724 | mxAAA | 4,900,000 | 493,085,260.50 | 8.63 |
| LF | BONDEF | 280224 | mxAAA | 4,800,000 | 478,296,163.20 | 8.37 |
| LF | BONDEF | 270114 | mxAAA | 2,500,000 | 250,528,435.00 | 4.38 |
| LF | BONDEF | 261001 | mxAAA | 2,500,000 | 250,205,880.00 | 4.38 |
| LF | BONDEF | 250424 | mxAAA | 2,350,000 | 235,222,157.25 | 4.11 |
| LF | BONDEF | 251023 | mxAAA | 2,000,000 | 200,839,060.00 | 3.51 |
| LF | BONDEF | 251218 | mxAAA | 1,600,000 | 160,654,988.80 | 2.81 |
| BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL | | | | | | |
| IM | BPAG28 | 250508 | mxAAA | 8,000,000 | 803,690,752.00 | 14.06 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 5,446,351,454.64 | 95.28 |
| REPORTO | | | | | | |
| IM | BPAG28 | 270204 | mxAAA | 1,784,519 | 179,094,945.50 | 3.13 |
| TOTAL REPORTO | | | | | 179,094,945.50 | 3.13 |
| OTROS VALORES | | | | 900,000 | 90,958,854.50 | 1.59 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 5,716,405,254.64 | 100.00 |

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAA/S2

VaR Promedio
0.003%

Límite de VaR
0.050%

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

Iván Alejandro Ramil Flores