

VINCI COMPASS

I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 09 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	250703	mxAAA	11,500,000	1,156,664,882.50	20.77
LF	BONDEF	251002	mxAAA	8,647,941	867,886,387.50	15.58
LF	BONDEF	250424	mxAAA	7,350,000	736,466,905.65	13.22
LF	BONDEF	260604	mxAAA	5,500,000	552,460,716.50	9.92
LF	BONDEF	250724	mxAAA	4,900,000	489,912,882.90	8.80
LF	BONDEF	261001	mxAAA	2,500,000	250,435,415.00	4.50
LF	BONDEF	251023	mxAAA	2,000,000	201,102,620.00	3.61
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	804,846,056.00	14.45
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,059,775,866.05	90.84
REPORTO						
LF	BONDEF	270128	mxAAA	3,500,000	349,614,665.32	6.28
TOTAL REPORTO					349,614,665.32	6.28
OTROS VALORES				1,600,185	160,861,777.07	2.89
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,570,252,308.44	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