

VINCI COMPASS

I-LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 20 FEBRERO, 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	250703	mxAAA	11,500,000	1,152,078,475.50	20.31
LF	BONDES F	251002	mxAAA	8,647,941	864,552,355.46	15.24
LF	BONDES F	260604	mxAAA	5,500,000	550,351,730.50	9.70
LF	BONDES F	250724	mxAAA	4,900,000	491,775,711.00	8.67
LF	BONDES F	280224	mxAAA	4,800,000	480,558,216.00	8.47
LF	BONDES F	270114	mxAAA	2,500,000	249,823,552.50	4.40
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	249,513,252.50	4.40
LF	BONDES F	250424	mxAAA	2,350,000	236,364,245.50	4.17
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	200,305,658.00	3.53
LF	BONDES F	251218	mxAAA	1,600,000	160,228,465.60	2.82
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	801,563,904.00	14.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,437,115,566.56	95.84
REPORTO						
LF	BONDES F	340323	mxAAA	1,476,475	145,520,352.41	2.57
TOTAL REPORTO					145,520,352.41	2.57
OTROS VALORES				900,000	90,718,811.00	1.60
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,673,354,729.97	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