

# VINCI COMPASS

I-LIQQ COMPASS INVESTMENTS UNO, 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
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	250703	mxAAA	11,500,000	1,154,314,501.00	19.45
LF	BONDES F	280224	mxAAA	8,800,000	876,307,608.00	14.77
LF	BONDES F	251002	mxAAA	8,647,941	866,234,890.21	14.60
LF	BONDES F	260604	mxAAA	5,500,000	551,598,542.00	9.30
LF	BONDES F	250724	mxAAA	4,900,000	492,716,800.10	8.30
LF	BONDES F	270114	mxAAA	2,500,000	250,378,697.50	4.22
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	250,056,252.50	4.21
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	200,694,158.00	3.38
LF	BONDES F	251218	mxAAA	1,600,000	160,537,660.80	2.71
<b>BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL</b>						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	803,088,496.00	13.53
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>5,605,927,606.11</b>	<b>94.48</b>
<b>REPORTO</b>						
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	1,802,817	181,050,671.22	3.05
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>181,050,671.22</b>	<b>3.05</b>
<b>OTROS VALORES</b>				1,450,000	146,682,337.55	2.47
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>5,933,660,614.88</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b> IDCPGUB	
<b>CALIFICACIÓN</b> AAA1/S2	<b>VaR Promedio</b> 0.003%	<b>Límite de VaR</b> 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