

VINCI COMPASS

I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 08 MAYO, 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	1,150,156,526.50	18.66
LF	BONDES F	280224	mxAAA	8,800,000	879,570,542.40	14.27
LF	BONDES F	251002	mxAAA	8,647,941	869,509,251.46	14.10
LF	BONDES F	260604	mxAAA	5,500,000	549,652,587.00	8.92
LF	BONDES F	250724	mxAAA	4,900,000	491,030,278.90	7.97
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	251,012,205.00	4.07
LF	BONDES F	270114	mxAAA	2,500,000	249,483,460.00	4.05
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	199,974,860.00	3.24
LF	BONDES F	251218	mxAAA	1,600,000	159,960,276.80	2.59
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE II				1,900,000	190,472,107.80	3.09
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,990,822,095.86	80.96
REPORTO						
IS	BPA182	301010	mxAAA	11,223,993	1,119,127,017.31	18.15
TOTAL REPORTO					1,119,127,017.31	18.15
OTROS VALORES				550,000	54,937,555.20	0.89
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,164,886,668.37	100.00

CATEGORÍA		
IDCPGUB		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAA1/S2	0.003%	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 Alexandro Ramil Flores