

VINCI COMPASS

I+USD COMPASS INVESTMENTS DIECIOCHO, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	USFR	*	ALTA	46,418	39,748,378.52	44.00
1ISP	FLOT	*	ALTA	16,978	14,731,843.79	16.31
1ISP	TFRN	N	ALTA	13,281	13,868,243.83	15.35
1ISP	VBIL	*	ALTA	6,596	8,488,065.51	9.40
1ISP	SGOV	*	ALTA	3,598	6,157,753.92	6.82
1ISP	BIL	*	ALTA	3,855	6,005,913.39	6.65
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					89,000,198.96	98.52
OTROS VALORES				21,546	1,337,870.29	1.48
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					90,338,069.25	100.00

CATEGORÍA
RVESD

CALIFICACIÓN
N/A

VaR Promedio
0.958%

Límite de VaR
1.500%

Se utiliza la metodología del VaR histórico. El modelo histórico calcula el VaR considerando los últimos 1,000 escenarios de valuación para los instrumentos contenidos en el portafolio del fondo. Tomando en cuenta estos escenarios, se valúa la posición actual para tener un vector de 1,000 elementos que contiene la pérdida o ganancia que tendría el portafolio dados esos escenarios. Posteriormente se ordenan los montos de menor a mayor y se determina el escenario de acuerdo con el nivel de confianza, en este caso se toma el escenario 51 correspondiente al nivel de confianza del 95%.

Iván Alexandro Ramil Flores

La tenencia indirecta en fondos de inversión o mecanismos de inversión colectiva que en lo individual representan más del 10% de la composición de la cartera, se podrán consultar en la siguiente liga de Internet:

<https://www.wisdomtree.com/us/products/fixed-income/usfr>
<https://www.ishares.com/us/products/239534/ishares-floating-rate-bond-etf>
<https://www.wisdomtree.com/gb/products/fixed-income/wisdomtree-usd-floating-rate-treasury-bond-ucits-etf---usd-acc>