

VINCI COMPASS

I+USD COMPASS INVESTMENTS DIECIOCHO, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 04 JUNIO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	USFR	*	ALTA	41,018	35,711,448.67	51.80
1ISP	FLOT	*	ALTA	14,747	12,976,833.38	18.82
1ISP	BIL	*	ALTA	3,151	4,979,541.75	7.22
1ISP	SGOV	*	ALTA	2,868	4,979,051.63	7.22
1ISP	VBIL	*	ALTA	3,410	4,450,318.26	6.46
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					63,097,193.69	91.53
REPORTO						
LF	BONDESF	270520	mxAAA	51,366	5,139,843.46	7.46
TOTAL REPORTO					5,139,843.46	7.46
OTROS VALORES				1,448	700,274.02	1.02
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					68,937,311.17	100.00

	CATEGORÍA RVESD	
CALIFICACIÓN N/A	VaR Promedio 0.909%	Limite 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 Alejandro Ramil Flores