

VINCI COMPASS

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 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	271202	mxAAA	500,000	50,042,910.00	4.08
LF	BONDES F	270819	mxAAA	500,000	50,000,562.50	4.07
LF	BONDES F	260604	mxAAA	400,000	40,032,307.20	3.26
LF	BONDES F	261001	mxAAA	258,692	25,999,137.11	2.12
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				790,000	79,093,063.18	6.45
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	2,350,000	228,048,714.10	18.59
M	BONOS	421113	mxAAA	1,500,000	134,168,635.50	10.93
M	BONOS	330526	mxAAA	1,220,000	118,081,707.70	9.62
M	BONOS	471107	mxAAA	810,000	73,123,368.03	5.96
M	BONOS	360221	mxAAA	550,000	52,305,404.80	4.26
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE IN				475,000	48,476,230.08	3.95
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	281130	mxAAA	62,294	53,824,787.90	4.39
S	UDIBONO	261203	mxAAA	39,162	33,555,755.51	2.73
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	10,000,000	97,142,630.00	7.92
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,083,895,213.61	88.33
REPORTO						
LF	BONDES F	270923	mxAAA	1,002,606	100,088,763.31	8.16
TOTAL REPORTO					100,088,763.31	8.16
OTROS VALORES				2,028,830	43,056,666.16	3.51
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,227,040,643.08	100.00

CATEGORÍA		
IDDISGUB		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAF.mx MRA1.mx	0.469%	0.950%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es 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