

VINCI COMPASS

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 30 JUNIO, 2026

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	50,030,030.50	3.76
LF	BONDES F	270819	mxAAA	500,000	49,994,589.00	3.76
LF	BONDES F	280928	mxAAA	300,000	30,003,654.30	2.25
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				858,692	86,013,024.11	6.46
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	2,350,000	220,174,557.35	16.54
M	BONOS	421113	mxAAA	1,725,000	148,511,353.05	11.16
M	BONOS	471107	mxAAA	1,565,000	135,387,531.83	10.17
M	BONOS	360221	mxAAA	1,310,000	125,844,663.99	9.45
M	BONOS	330526	mxAAA	1,220,000	114,693,571.28	8.62
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTE				475,000	47,609,836.50	3.58
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	281130	mxAAA	62,294	55,111,056.40	4.14
S	UDIBONO	261203	mxAAA	39,162	34,516,354.84	2.59
OTROS TIPO DE VALOR S - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGA				40,395	35,234,095.13	2.65
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	290503	mxAAA	500,000	49,986,449.00	3.75
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	271223	mxAAA	10,500,000	94,283,416.50	7.08
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,277,394,183.78	95.96
REPORTO						
BI	CETES	280217	mxAAA	3,248,553	28,554,201.65	2.15
TOTAL REPORTO					28,554,201.65	2.15
OTROS VALORES				2,600,000	25,276,003.60	1.90
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,331,224,389.03	100.00

CATEGORÍA IDDISGUB

CALIFICACIÓN
AAAf.mx MRA1.mx

VaR Promedio
0.491%

Límite de VaR
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