

VINCI COMPASS

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 05 MARZO, 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	49,947,095.50	3.68
LF	BONDES F	270819	mxAAA	500,000	49,918,445.00	3.68
LF	BONDES F	260604	mxAAA	400,000	40,165,819.20	2.96
LF	BONDES F	280928	mxAAA	300,000	29,959,817.10	2.21
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				858,692	85,908,683.64	6.33
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	2,350,000	224,112,969.35	16.51
M	BONOS	421113	mxAAA	1,725,000	151,862,557.13	11.19
M	BONOS	471107	mxAAA	1,515,000	134,369,079.93	9.90
M	BONOS	360221	mxAAA	1,260,000	117,857,437.74	8.68
M	BONOS	330526	mxAAA	1,220,000	116,565,468.52	8.59
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INT				475,000	48,270,011.18	3.56
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	281130	mxAAA	62,294	55,213,008.25	4.07
S	UDIBONO	261203	mxAAA	39,162	34,238,070.10	2.52
OTROS TIPO DE VALOR S - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREG				40,395	35,324,364.17	2.60
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	271223	mxAAA	10,500,000	92,063,506.50	6.78
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,265,776,333.31	93.23
REPORTO						
LF	BONDES F	300124	mxAAA	677,365	67,204,967.05	4.95
TOTAL REPORTO					67,204,967.05	4.95
OTROS VALORES				2,600,000	24,681,991.20	1.82
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,357,663,291.56	100.00

CATEGORÍA
IDDISGUB

CALIFICACIÓN
AAAf.mx MRA1.mx

VaR Promedio
0.502%

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