

VINCI COMPASS

I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 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	280224	mxAAA	8,800,000	876,932,883.20	7.48
LF	BONDES F	260521	mxAAA	6,760,000	676,093,179.84	5.77
LF	BONDES F	260604	mxAAA	5,500,000	551,472,405.00	4.70
LF	BONDES F	261001	mxAAA	5,351,559	535,797,391.38	4.57
LF	BONDES F	260226	mxAAA	5,000,000	500,150,545.00	4.27
LF	BONDES F	260326	mxAAA	3,656,500	365,740,143.69	3.12
LF	BONDES F	261022	mxAAA	3,333,330	334,135,552.53	2.85
LF	BONDES F	270114	mxAAA	2,500,000	250,513,080.00	2.14
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				9,504,604	950,119,604.06	8.10
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE II				3,400,000	342,352,713.60	2.92
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260611	mxAAA	50,000,000	484,124,300.00	4.13
BI	CETES	260122	mxAAA	40,000,000	398,407,680.00	3.40
BI	CETES	260108	mxAAA	30,000,000	299,636,280.00	2.56
BI	CETES	270513	mxAAA	30,000,000	270,963,150.00	2.31
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUES				31,900,000	308,460,428.00	2.63
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					7,144,899,336.30	60.94
REPORTO						
LF	BONDES F	291101	mxAAA	23,007,652	2,275,759,087.04	19.41
LF	BONDES F	300124	mxAAA	13,126,265	1,300,534,436.12	11.09
IQ	BPAG91	280907	mxAAA	5,770,706	575,258,626.21	4.91
IM	BPAG28	280803	mxAAA	4,302,750	428,045,514.77	3.65
TOTAL REPORTO					4,579,597,664.14	39.06
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					11,724,497,000.44	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAAF.mx MRA1.mx

VaR Promedio
0.006%

Límite de VaR
0.050%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico de volatilidad estable, con un horizonte temporal de un día que utiliza los 320 datos más recientes para componer el 50% de la volatilidad y otros 1600 datos anteriores para componer el otro 50%.

Iván Alejandro Ramil Flores