

VINCI COMPASS

I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 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	261203	mxAAA	10,500,000	1,053,869,575.50	10.87
LF	BONDES F	280224	mxAAA	8,800,000	882,013,704.00	9.10
LF	BONDES F	270415	mxAAA	5,953,670	598,154,794.07	6.17
LF	BONDES F	270114	mxAAA	4,500,000	450,487,543.50	4.65
LF	BONDES F	270318	mxAAA	3,000,000	301,424,598.00	3.11
LF	BONDES F	270617	mxAAA	3,000,000	300,988,500.00	3.11
LF	BONDES F	270422	mxAAA	2,960,000	297,014,184.80	3.06
LF	BONDES F	270520	mxAAA	2,850,000	285,958,170.00	2.95
LF	BONDES F	261231	mxAAA	2,000,000	200,728,158.00	2.07
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				7,583,330	760,035,325.87	7.84
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	290503	mxAAA	7,000,000	697,909,758.00	7.20
IM	BPAG28	270506	mxAAA	3,000,000	300,250,410.00	3.10
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 INTE				3,000,000	301,694,548.00	3.11
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	270527	mxAAA	50,000,000	477,798,950.00	4.93
BI	CETES	270624	mxAAA	45,000,000	427,580,145.00	4.41
BI	CETES	280412	mxAAA	45,000,000	400,675,005.00	4.13
BI	CETES	270107	mxAAA	30,000,000	294,613,290.00	3.04
BI	CETES	270513	mxAAA	30,000,000	287,449,350.00	2.97
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				40,900,000	377,696,479.60	3.90
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					8,696,342,489.34	89.73
REPORTO						
IM	BPAG28	261105	mxAAA	4,600,000	461,714,008.63	4.76
LF	BONDES F	270923	mxAAA	2,782,582	278,421,569.91	2.87
IQ	BPAG91	310918	mxAAA	2,074,437	205,097,518.60	2.12
TOTAL REPORTO					945,233,097.14	9.75
OTROS VALORES				500,000	50,112,941.50	0.52
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					9,691,688,527.98	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAAf.mx MRA1.mx

VaR Promedio
0.012%

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 Alexandro Ramil Flores