



I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 25 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDEF	250116	mxAAA	3,165,230	317,775,491.01	7.26
LF	BONDEF	260604	mxAAA	2,500,000	250,459,425.00	5.72
LF	BONDEF	250102	mxAAA	2,500,000	249,924,747.50	5.71
LF	BONDEF	261001	mxAAA	2,500,000	249,767,195.00	5.71
LF	BONDEF	251023	mxAAA	2,000,000	200,566,620.00	4.58
LF	BONDEF	240725	mxAAA	1,001,803	100,833,858.24	2.30
LF	BONDEF	241024	mxAAA	1,000,000	100,415,388.00	2.29
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	8,727,214	874,568,322.84	19.99
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	802,860,824.00	18.35
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	301,789,551.00	6.90
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 INT				900,000	90,959,410.20	2.08
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,539,920,832.79	80.89
REPORTO						
LF	BONDEF	271014	mxAAA	7,677,650	766,024,489.94	17.51
TOTAL REPORTO					766,024,489.94	17.51
OTROS VALORES				700,000	70,016,644.60	1.60
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,375,961,967.33	100.00

	CATEGORÍA IDCPGUB	
CALIFICACIÓN AAA/S2	VaR Promedio 0.003%	Límite de VaR 0.050%

El Fondo de inversión no se encuentra en una estrategia temporal de inversión

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