



I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual	
DIRECTO							
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F							
LF	BONDES F	240425	mxAAA	5,494,005	550,207,981.38	12.61	
LF	BONDES F	250116	mxAAA	3,165,230	318,064,286.59	7.29	
LF	BONDES F	260604	mxAAA	2,500,000	250,621,337.50	5.75	
LF	BONDES F	250102	mxAAA	2,500,000	250,218,367.50	5.74	
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	249,921,987.50	5.73	
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	200,717,832.00	4.60	
LF	BONDES F	240725	mxAAA	1,001,803	100,928,134.92	2.31	
LF	BONDES F	241024	mxAAA	1,000,000	100,508,402.00	2.30	
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL							
IM	BPAG28	240808	mxAAA	8,727,214	875,421,259.65	20.07	
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	302,086,818.00	6.93	
IM	BPAG28	250508	mxAAA	3,000,000	301,288,200.00	6.91	
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 INI					900,000	91,704,823.40	2.10
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO						3,591,689,430.44	82.34
REPORTO							
LF	BONDES F	270422	mxAAA	7,027,103	700,094,572.03	16.05	
TOTAL REPORTO						700,094,572.03	16.05
OTROS VALORES				700,000	70,097,399.40	1.61	
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES						4,361,881,401.87	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAAI/S2

VaR Promedio
0.000%

Límite de VaR
0.001%

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