



I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	251002	mxAAA	4,347,941	435,949,308.79	9.21
LF	BONDES F	250116	mxAAA	3,165,230	318,374,612.07	6.73
LF	BONDES F	260604	mxAAA	2,500,000	250,934,840.00	5.30
LF	BONDES F	250102	mxAAA	2,500,000	250,395,347.50	5.29
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	250,256,232.50	5.29
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	200,939,074.00	4.25
LF	BONDES F	240725	mxAAA	1,001,803	101,023,339.26	2.13
LF	BONDES F	241024	mxAAA	1,000,000	100,604,797.00	2.13
<b>BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL</b>						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	8,727,214	876,208,183.81	18.51
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	804,356,632.00	16.99
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	302,349,126.00	6.39
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>3,891,391,492.93</b>	<b>82.22</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDES F	250522	mxAAA	4,000,000	401,026,550.67	8.47
IS	BPA182	300328	mxAAA	2,789,874	279,289,365.73	5.90
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>680,315,916.40</b>	<b>14.37</b>
<b>OTROS VALORES</b>				1,600,000	<b>161,279,716.70</b>	<b>3.41</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>4,732,987,126.03</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
IDCPGUB

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/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