



COMPASS

I+LIQ COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 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	250703	mxAAA	11,500,000	1,152,046,827.50	17.49
LF	BONDES F	251002	mxAAA	8,647,941	864,351,213.00	13.12
LF	BONDES F	250424	mxAAA	7,350,000	739,456,099.20	11.23
LF	BONDES F	260604	mxAAA	5,500,000	550,214,736.50	8.35
LF	BONDES F	250724	mxAAA	4,900,000	491,850,627.10	7.47
LF	BONDES F	250116	mxAAA	3,165,230	317,214,643.90	4.82
LF	BONDES F	250102	mxAAA	2,500,000	251,579,432.50	3.82
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	249,404,362.50	3.79
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	200,297,384.00	3.04
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	801,517,912.00	12.17
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	301,262,697.00	4.57
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,919,195,935.20	89.87
REPORTO						
LF	BONDES F	270930	mxAAA	5,786,307	575,747,197.86	8.74
TOTAL REPORTO					575,747,197.86	8.74
OTROS VALORES				900,000	91,200,840.80	1.38
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,586,143,973.86	100.00

	CATEGORÍA IDCPGUB	
CALIFICACIÓN AAA/S2	VaR Promedio 0.003%	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