



I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 18 ABRIL, 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	553,277,839.09	12.64
LF	BONDES F	250116	mxAAA	3,165,230	317,090,823.27	7.24
LF	BONDES F	250102	mxAAA	2,500,000	251,612,485.00	5.75
LF	BONDES F	260604	mxAAA	2,500,000	249,890,797.50	5.71
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	249,204,505.00	5.69
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	200,121,794.00	4.57
LF	BONDES F	240725	mxAAA	1,001,803	100,616,675.37	2.30
LF	BONDES F	241024	mxAAA	1,000,000	100,199,036.00	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	872,691,605.29	19.93
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	801,136,752.00	18.30
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	301,140,102.00	6.88
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	90,770,365.70	2.07
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,087,752,780.22	93.36
REPORTO						
LF	BONDES F	271014	mxAAA	2,211,673	220,195,265.47	5.03
TOTAL REPORTO					220,195,265.47	5.03
OTROS VALORES				700,000	70,489,128.50	1.61
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,378,437,174.19	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAA/1/2

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 Alexandro Ramil Flores