



COMPASS

I+LIQ COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 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	1,156,815,049.50	18.00
LF	BONDES F	251002	mxAAA	8,647,941	867,927,136.60	13.50
LF	BONDES F	250424	mxAAA	7,350,000	736,463,620.20	11.46
LF	BONDES F	260604	mxAAA	5,500,000	552,501,669.50	8.60
LF	BONDES F	250724	mxAAA	4,900,000	489,857,243.40	7.62
LF	BONDES F	250116	mxAAA	3,165,230	318,526,340.54	4.96
LF	BONDES F	250102	mxAAA	2,500,000	250,561,067.50	3.90
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	250,442,062.50	3.90
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	201,128,596.00	3.13
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	804,825,104.00	12.52
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	300,050,931.00	4.67
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,929,098,820.74	92.25
REPORTO						
IQ	BPAG91	280106	mxAAA	4,059,286	407,710,124.34	6.34
TOTAL REPORTO					407,710,124.34	6.34
OTROS VALORES				900,000	90,457,435.70	1.41
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,427,266,380.78	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%.