



COMPASS

I+LIQ COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 19 DICIEMBRE, 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	1,149,804,833.50	20.85
LF	BONDES F	251002	mxAAA	8,647,941	869,668,088.20	15.77
LF	BONDES F	250424	mxAAA	7,350,000	737,937,728.85	13.38
LF	BONDES F	260604	mxAAA	5,500,000	549,164,005.50	9.96
LF	BONDES F	250724	mxAAA	4,900,000	491,011,977.40	8.90
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	250,953,425.00	4.55
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	199,909,532.00	3.62
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	799,994,728.00	14.51
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,048,444,318.45	91.54
REPORTO						
LF	BONDES F	270923	mxAAA	3,777,946	375,217,751.80	6.80
TOTAL REPORTO					375,217,751.80	6.80
OTROS VALORES				900,000	91,413,493.70	1.66
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,515,075,563.95	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 Alejandro Ramil Flores