



I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 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	BONDEF	250424	mxAAA	7,350,000	737,020,434.15	14.77
LF	BONDEF	251002	mxAAA	4,347,941	436,622,330.93	8.75
LF	BONDEF	250116	mxAAA	3,165,230	318,823,584.12	6.39
LF	BONDEF	260604	mxAAA	2,500,000	251,308,872.50	5.03
LF	BONDEF	250102	mxAAA	2,500,000	250,747,267.50	5.02
LF	BONDEF	261001	mxAAA	2,500,000	250,534,075.00	5.02
LF	BONDEF	251023	mxAAA	2,000,000	201,253,956.00	4.03
LF	BONDEF	241024	mxAAA	1,000,000	100,742,717.00	2.02
LF	BONDEF	240725	mxAAA	1,001,803	100,298,062.94	2.01
<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	877,431,660.67	17.58
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	805,583,816.00	16.14
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	300,200,367.00	6.01
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>4,630,567,143.81</b>	<b>92.77</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDEF	290419	mxAAA	2,710,122	269,185,985.37	5.39
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>269,185,985.37</b>	<b>5.39</b>
<b>OTROS VALORES</b>				900,000	<b>91,683,206.60</b>	<b>1.84</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>4,991,436,335.78</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b> IDCPGUB	
<b>CALIFICACIÓN</b> AAAf/S2	<b>VaR Promedio</b> 0.003%	<b>Límite de VaR</b> 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%.