



I+LIQG COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 27 JUNIO, 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	250424	mxAAA	7,350,000	736,338,817.20	14.81
LF	BONDES F	251002	mxAAA	4,347,941	436,217,398.49	8.78
LF	BONDES F	250116	mxAAA	3,165,230	318,528,600.51	6.41
LF	BONDES F	260604	mxAAA	2,500,000	251,075,015.00	5.05
LF	BONDES F	250102	mxAAA	2,500,000	250,515,422.50	5.04
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	250,300,535.00	5.04
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	201,067,106.00	4.05
LF	BONDES F	241024	mxAAA	1,000,000	100,649,490.00	2.03
LF	BONDES F	240725	mxAAA	1,001,803	100,205,331.05	2.02
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	8,727,214	876,623,529.38	17.64
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	804,841,960.00	16.19
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	299,923,692.00	6.03
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,626,286,897.13	93.08
REPORTO						
LF	BONDES F	270114	mxAAA	2,517,990	252,554,211.29	5.08
TOTAL REPORTO					252,554,211.29	5.08
OTROS VALORES				900,000	91,598,484.00	1.84
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,970,439,592.42	100.00

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