



COMPASS

I+LIQQ COMPASS INVESTMENTS UNO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 18 JULIO, 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	251002	mxAAA	8,647,941	865,818,379.43	14.55
LF	BONDES F	250424	mxAAA	7,350,000	734,794,376.40	12.35
LF	BONDES F	250116	mxAAA	3,165,230	317,861,347.87	5.34
LF	BONDES F	260604	mxAAA	2,500,000	250,553,967.50	4.21
LF	BONDES F	250102	mxAAA	2,500,000	249,990,132.50	4.20
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,500,000	249,768,247.50	4.20
LF	BONDES F	251023	mxAAA	2,000,000	200,648,680.00	3.37
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				2,001,803	201,294,440.26	3.38
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	8,727,214	874,814,500.10	14.70
IM	BPAG28	250508	mxAAA	8,000,000	803,166,400.00	13.50
IM	BPAG28	250206	mxAAA	3,000,000	301,866,780.00	5.07
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,050,577,251.56	84.89
REPORTO						
LF	BONDES F	251023	mxAAA	3,083,129	309,312,683.41	5.20
LF	BONDES F	270128	mxAAA	2,507,637	249,934,199.83	4.20
LF	BONDES F	270930	mxAAA	2,500,000	249,214,284.13	4.19
TOTAL REPORTO					808,461,167.37	13.59
OTROS VALORES				900,000	90,794,434.70	1.53
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,949,832,853.63	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAA/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%.

Iván Alejandro Ramil Flores