

**COMPASS**I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	260604	mxAAA	400,000	40,149,574.40	2.21
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	6,600,000	586,046,023.20	32.23
M	BONOS	330526	mxAAA	2,970,000	262,549,868.13	14.44
M	BONOS	421113	mxAAA	1,200,000	100,664,070.00	5.54
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INT						
				475,000	45,011,745.80	2.48
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	2,000,000	201,089,158.00	11.06
IM	BPAC28	250206	mxAAA	1,000,000	100,783,042.00	5.54
IM	BPAG28	240808	mxAAA	1,000,000	100,399,530.00	5.52
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	14,500,000	121,613,501.00	6.69
BI	CETES	260219	mxAAA	10,000,000	82,618,420.00	4.54
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,640,924,932.53	90.24
REPORTO						
IS	BPA182	270401	mxAAA	1,306,788	131,335,478.01	7.22
TOTAL REPORTO					131,335,478.01	7.22
OTROS VALORES				285,466	46,232,872.03	2.54
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,818,493,282.57	100.00

CATEGORÍA
IDDISGUBCALIFICACIÓN
AAAf/S4VaR Promedio
0.419%Límite de VaR
0.950%

El Fondo de inversión no se encuentra en una estrategia temporal de inversión

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo histórico calcula el VaR considerando los últimos 1,000 escenarios de valuación para los instrumentos contenidos en el portafolio del fondo. Tomando en cuenta estos escenarios, se valúa la posición actual para tener un vector de 1,000 elementos que contiene la pérdida o ganancia que tendría el portafolio dados esos escenarios. Posteriormente se ordenan los montos de menor a mayor y se determina el escenario de acuerdo con el nivel de confianza, en este caso se toma el escenario 51 correspondiente al nivel de confianza del 95%.

Iván Alejandro Ramil Flores