

**COMPASS**

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, 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	BONDES F	260604	mxAAA	400,000	40,209,419.60	2.45
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA</b>						
M	BONOS	341123	mxAAA	6,250,000	543,389,537.50	33.15
M	BONOS	330526	mxAAA	2,970,000	257,241,337.65	15.69
M	BONOS	421113	mxAAA	1,200,000	98,015,486.40	5.98
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INT				475,000	44,086,554.68	2.69
<b>BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL</b>						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	2,000,000	201,395,954.00	12.29
IM	BPAG28	250206	mxAAA	1,000,000	100,066,789.00	6.10
IM	BPAG28	240808	mxAAA	500,000	50,269,860.50	3.07
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>						
BI	CETES	251224	mxAAA	14,500,000	123,808,192.00	7.55
BI	CETES	260219	mxAAA	10,000,000	84,101,200.00	5.13
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>1,542,584,331.33</b>	<b>94.11</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDES F	290419	mxAAA	506,911	50,349,518.22	3.07
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>50,349,518.22</b>	<b>3.07</b>
<b>OTROS VALORES</b>				285,466	<b>46,214,079.73</b>	<b>2.82</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>1,639,147,929.28</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b> IDDISGUB	
<b>CALIFICACIÓN</b> AAA/SS	<b>VaR Promedio</b> 0.403%	<b>Límite de VaR</b> 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