

**COMPASS**

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 16 MAYO, 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	260604	mxAAA	400,000	39,996,858.40	2.17
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	6,300,000	573,631,216.20	31.06
M	BONOS	330526	mxAAA	2,970,000	268,266,348.90	14.52
M	BONOS	421113	mxAAA	1,200,000	103,775,457.60	5.62
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INT				475,000	45,722,064.20	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	200,331,862.00	10.85
IM	BPAG28	250206	mxAAA	1,000,000	100,383,551.00	5.43
IM	BPAG28	240808	mxAAA	1,000,000	100,009,369.00	5.41
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	14,500,000	122,557,103.00	6.64
BI	CETES	260219	mxAAA	10,000,000	83,256,110.00	4.51
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,637,929,940.30	88.68
REPORTO						
LF	BONDES F	270225	mxAAA	1,622,970	162,723,692.17	8.81
TOTAL REPORTO					162,723,692.17	8.81
OTROS VALORES				285,466	46,370,635.67	2.51
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,847,024,268.14	100.00

	CATEGORÍA IDDISGUB	
CALIFICACIÓN AAAf/S4	VaR Promedio 0.401%	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