

**COMPASS**

I+GUBER COMPASS INVESTMENTS DOS, 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	260604	mxAAA	400,000	40,172,002.40	2.46
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	6,250,000	541,124,162.50	33.08
M	BONOS	330526	mxAAA	2,970,000	257,193,998.82	15.72
M	BONOS	421113	mxAAA	1,200,000	97,679,263.20	5.97
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INT				475,000	43,971,759.38	2.69
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	2,000,000	201,210,490.00	12.30
IM	BPAG28	250206	mxAAA	1,000,000	99,974,564.00	6.11
IM	BPAG28	240808	mxAAA	500,000	50,223,561.00	3.07
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	14,500,000	123,660,408.00	7.56
BI	CETES	260219	mxAAA	10,000,000	83,987,700.00	5.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,539,197,909.30	94.10
REPORTO						
IS	BPA182	240905	mxAAA	486,040	50,333,334.82	3.08
TOTAL REPORTO					50,333,334.82	3.08
OTROS VALORES				285,466	46,136,804.31	2.82
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,635,668,048.43	100.00

CATEGORÍA
IDDISGUB

CALIFICACIÓN
AAAf/S4

VaR Promedio
0.402%

Límite de VaR
0.950%

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