



**BX+MP COMPASS INVESTMENTS CUATRO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 ENERO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHM	CBXMAS	0209582		198,877,616	198,924,121.76	36.27
TOTAL DISPONIBILIDADES					198,924,121.76	36.27
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	190228	mxAAA	2,500,000	24,850,895.00	4.53
BI	CETES	190411	mxAAA	2,500,000	24,615,950.00	4.49
IQ	BPAG91	190417	mxAAA	350,000	35,120,219.75	6.40
LD	BONDES	190328	mxAAA	120,000	12,001,976.76	2.19
LD	BONDES	190606	mxAAA	300,000	30,097,967.40	5.49
S	UDIBONO	190613	mxAAA	38,209	23,734,906.99	4.33
S	UDIBONO	201210	mxAAA	16,646	10,121,188.96	1.85
S	UDIBONO	251204	mxAAA	25,297	16,243,781.81	2.96
PAPEL PRIVADO						
JE	AMX	0619	mxAAA	1,700	16,955,852.98	3.09
91	FICEICB	17	mxAAA	200,000	20,027,188.20	3.65
91	HIRCB	18	AAA(mex)	30,000	2,288,165.10	0.42
91	RUBA	15	mxA	300,000	17,503,829.70	3.19
91	TIPCB	17	AAA(mex)	150,000	15,158,990.85	2.76
91	VANRECB	18	mxAA	43,383	4,352,704.37	0.79
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					253,073,617.87	46.14
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					253,073,617.87	46.14
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IM	BPAG28	200514	mxAAA	964,511	96,511,104.81	17.60
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					96,511,104.81	17.60
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					548,508,844.44	100.00

**CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL**

CALIFICACIÓN
AAI/S4

VaR Promedio
0.015%

Límite de VaR
0.420%

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%.

Jose Ignacio Armendariz Morales