



**BX+CP COMPASS INVESTMENTS TRECE, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 07 FEBRERO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHM	CBXMAS	0209589		739,025,867	739,198,599.79	29.63
TOTAL DISPONIBILIDADES					739,198,599.79	29.63
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	190214	mxAAA	5,000,000	49,934,490.00	2.00
BI	CETES	190228	mxAAA	7,500,000	74,674,335.00	2.99
BI	CETES	190328	mxAAA	10,000,000	98,932,030.00	3.97
BI	CETES	190411	mxAAA	5,000,000	49,309,585.00	1.98
BI	CETES	190509	mxAAA	7,500,000	73,505,992.50	2.95
BI	CETES	190718	mxAAA	15,063,600	145,308,682.54	5.82
BI	CETES	190801	mxAAA	12,500,000	120,201,212.50	4.82
LD	BONDESD	190328	mxAAA	280,000	28,050,185.80	1.12
LD	BONDESD	190801	mxAAA	500,349	50,275,255.65	2.02
LD	BONDESD	191003	mxAAA	503,860	50,541,960.79	2.03
S	UDIBONO	190613	mxAAA	177,981	110,660,193.11	4.44
TÍTULOS BANCARIOS						
94	SCOTIAB	17	mxAAA	200,000	20,058,761.00	0.80
PAPEL PRIVADO						
91	CAUTOCB	16	AAA(mex)	95,021	7,352,461.20	0.29
91	VANRECB	18	mxAA	173,533	17,448,076.09	0.70
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					896,253,221.18	35.92
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					896,253,221.18	35.92
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	210826	mxAAA	5,180,902	524,872,969.75	21.04
IQ	BPAG91	230831	mxAAA	3,321,104	334,682,933.43	13.41
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					859,555,903.18	34.45
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,495,007,724.15	100.00

**CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO**

CALIFICACIÓN
AAA/S3

VaR Promedio
0.006%

Límite de VaR
0.080%

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%.