



**BX+CAP Compass Investments Catorce, S.A. de C.V. , Fondo de Inversion de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 07 FEBRERO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TITULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	MEXCHEM	*	ALTA	61,250	3,163,562.50	13.94
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	GRUMA	B	ALTA	18,000	4,186,080.00	18.45
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
CF	FUNO	11	ALTA	33,390	883,833.30	3.89
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	101,550	4,428,595.50	19.51
1ISP	SHY	*	ALTA	863	1,381,489.02	6.09
1ISP	SPY	*	ALTA	1,674	8,650,860.71	38.12
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					22,694,421.03	100.00
TOTAL TITULOS PARA NEGOCIAR					22,694,421.03	100.00
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					22,694,421.03	100.00

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.193%

Límite de VaR
3.800%

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 1 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