

BMERGOB
FONDO BBVA BANCOMER DEUDA CAJA, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
IM	BPAG28	190221	mxAAA	669,202,860.13	1.32
IM	BPAG28	190516	mxAAA	401,323,508.00	.79
IM	BPAG28	190725	mxAAA	1,235,046,112.11	2.44
IM	BPAG28	191121	mxAAA	299,518,101.00	.59
IM	BPAG28	200220	mxAAA	150,325,302.00	.30
IQ	BPAG91	180614	mxAAA	302,678,412.00	.60
IQ	BPAG91	181220	mxAAA	302,099,889.00	.60
IQ	BPAG91	190417	mxAAA	240,274,432.80	.47
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	502,683,125.00	.99
IS	BPA182	180104	mxAAA	1,125,725,315.00	2.22
IS	BPA182	180705	mxAAA	895,451,632.52	1.77
IS	BPA182	181011	mxAAA	100,337,580.00	.20
IS	BPA182	190103	mxAAA	501,103,963.50	.99
IS	BPA182	190411	mxAAA	116,442,087.45	.23
IS	BPA182	200130	mxAAA	396,446,918.40	.78
LD	BONDESD	171221	mxAAA	3,167,723,081.80	6.25
LD	BONDESD	180215	mxAAA	3,542,226,397.23	6.99
LD	BONDESD	180328	mxAAA	506,675,275.08	1.00
LD	BONDESD	180405	mxAAA	100,222,310.00	.20
LD	BONDESD	180419	mxAAA	1,298,847,718.55	2.56
LD	BONDESD	180614	mxAAA	2,888,191,366.97	5.70
LD	BONDESD	180628	mxAAA	2,768,434,870.19	5.46
LD	BONDESD	180705	mxAAA	400,585,069.69	.79
LD	BONDESD	180816	mxAAA	401,310,436.00	.79
LD	BONDESD	180927	mxAAA	2,560,307,228.65	5.05
LD	BONDESD	181011	mxAAA	902,867,931.00	1.78
LD	BONDESD	181213	mxAAA	644,241,452.07	1.27
LD	BONDESD	190207	mxAAA	250,287,745.00	.49
LD	BONDESD	190606	mxAAA	949,157,416.50	1.87
S	UDIBONO	190613	mxAAA	563,676,171.09	1.11
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				28,183,413,708.73	55.58
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				28,183,413,708.73	55.58
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADO					
IM	BPAG28	181122	mxAAA	2,436,277,849.76	4.80
IM	BPAG28	190221	mxAAA	3,082,774,111.57	6.08
IQ	BPAG91	190822	mxAAA	505,073,514.88	1.00
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	932,130,358.24	1.84
IQ	BPAG91	200423	mxAAA	1,685,606,873.27	3.32
IQ	BPAG91	220428	mxAAA	536,123,499.89	1.06
IQ	BPAG91	220428	mxAAA	2,519,858,161.20	4.97
IS	BPA182	190704	mxAAA	512,917,627.36	1.01
IS	BPA182	200130	mxAAA	511,087,906.12	1.01
IS	BPA182	220310	mxAAA	2,203,899,365.50	4.35
LD	BONDESD	200528	mxAAA	2,291,429,150.19	4.52
LD	BONDESD	220113	mxAAA	2,486,665,786.29	4.90

M	BONOS	191211	mxAAA	2,500,486,754.47	4.93
M	BONOS	191211	mxAAA	322,591,777.38	.64
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				22,526,922,736.12	44.42
TOTAL DE INVERSION EN VALORES				50,710,336,444.85	100.00

CLASIFICACIÓN

108

CALIFICACIÓN

AAA/1

VaR Promedio Mes

0.005936%

Límite de VaR

0.030%

Valor en Riesgo (VaR). El método de VaR utilizado es el histórico, para su cálculo se utilizan las matrices de escenarios proporcionadas por el Proveedor Oficial de Precios. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado. Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 13avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana

El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en el fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultánea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto.