

BMERTES

FONDO BBVA BANCOMER DEUDA GUBERNAMENTAL DE CORTO PLAZO, 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	167,300,740.13	1.98
IM	BPAG28	190516	mxAAA	200,661,754.00	2.38
IM	BPAG28	190725	mxAAA	400,110,184.00	4.74
IS	BPA182	180104	mxAAA	235,378,929.50	2.79
IS	BPA182	180705	mxAAA	29,293,455.02	.35
IS	BPA182	181011	mxAAA	100,337,580.00	1.19
IS	BPA182	190103	mxAAA	204,532,230.00	2.42
LD	BONDESD	180215	mxAAA	701,938,893.98	8.32
LD	BONDESD	180328	mxAAA	911,132,313.52	10.80
LD	BONDESD	180419	mxAAA	703,443,986.00	8.34
LD	BONDESD	180614	mxAAA	524,486,904.92	6.22
LD	BONDESD	180628	mxAAA	191,579,560.68	2.27
LD	BONDESD	180816	mxAAA	246,137,134.30	2.92
LD	BONDESD	180927	mxAAA	30,012,923.10	.36
LD	BONDESD	181011	mxAAA	30,873,368.26	.37
LD	BONDESD	190411	mxAAA	199,871,208.00	2.37
S	UDIBONO	190613	mxAAA	112,735,114.12	1.34
TÍTULOS BANCARIOS					
F	BACOMER	17084	mxA-1+	200,869,866.00	2.38
F	BACOMER	17094	mxA-1+	200,330,850.00	2.37
F	BACOMER	17128	mxA-1+	150,182,512.50	1.78
F	BANAMEX	7432	mxA-1+	100,560,342.00	1.19
F	BANAMEX	7436	mxA-1+	50,135,171.50	.59
F	BANAMEX	7438	mxA-1+	70,304,453.10	.83
F	BANSAN	17016	MX-1	100,391,848.00	1.19
F	BSCTIA	17005	mxA-1+	100,271,201.00	1.19
F	BSCTIA	17012	mxA-1+	25,046,950.75	.30
F	BSCTIA	17013	mxA-1+	25,046,950.75	.30
I	BACMEXT	17454	mxA-1+	502,005,491.57	5.95
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				6,514,971,916.70	77.20
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				6,514,971,916.70	77.20
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADO					
IQ	BPAG91	210422	mxAAA	1,170,228,117.07	13.87
S	UDIBONO	190613	mxAAA	753,381,845.87	8.93
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				1,923,609,962.94	22.80
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				8,438,581,879.64	100.00

CLASIFICACIÓN

108

VaR Promedio Mes

0.006508%

CALIFICACIÓN

AAA/1

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.