

BMRGOB2
FONDO BBVA BANCOMER EMPRESAS Y GOBIERNO, S.A DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 16 NOVIEMBRE, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
BI	CETES	180315	mxAAA	1,465,510,500.00	9.23
BI	CETES	180510	mxAAA	1,545,834,400.00	9.74
IM	BPAG28	190725	mxAAA	1,076,813,082.80	6.78
IM	BPAG28	191121	mxAAA	679,099,892.28	4.28
IQ	BPAG91	180614	mxAAA	202,422,288.00	1.27
IS	BPA182	180104	mxAAA	217,101,306.09	1.37
IS	BPA182	180412	mxAAA	252,299,527.81	1.59
IS	BPA182	180705	mxAAA	109,152,340.43	.69
IS	BPA182	181011	mxAAA	241,534,632.00	1.52
IS	BPA182	190103	mxAAA	307,757,628.00	1.94
LD	BONDESD	180215	mxAAA	552,277,451.00	3.48
LD	BONDESD	180328	mxAAA	100,130,607.00	.63
LD	BONDESD	180419	mxAAA	210,588,747.60	1.33
LD	BONDESD	180614	mxAAA	1,545,096,625.22	9.73
LD	BONDESD	180628	mxAAA	499,854,330.00	3.15
LD	BONDESD	180816	mxAAA	445,765,242.13	2.81
LD	BONDESD	180927	mxAAA	284,618,561.46	1.79
LD	BONDESD	181011	mxAAA	487,275,415.85	3.07
LD	BONDESD	181213	mxAAA	287,987,088.25	1.81
LD	BONDESD	190207	mxAAA	599,316,234.00	3.77
LD	BONDESD	190411	mxAAA	250,635,010.00	1.58
LD	BONDESD	191226	mxAAA	200,045,882.00	1.26
M	BONOS	171214	mxAAA	310,122,945.00	1.95
S	UDIBONO	190613	mxAAA	505,531,290.18	3.18
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				12,376,771,027.10	77.94
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				12,376,771,027.10	77.94
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADO					
LD	BONDESD	210325	mxAAA	1,494,292,126.29	9.41
M	BONOS	191211	mxAAA	1,142,690,119.82	7.20
S	UDIBONO	190613	mxAAA	341,942,427.11	2.15
S	UDIBONO	201210	mxAAA	523,407,930.25	3.30
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				3,502,332,603.47	22.06
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				15,879,103,630.57	100.00

CLASIFICACIÓN
108

CALIFICACIÓN
AAA/2

VaR Promedio última semana
0.011110%

Límite de VaR
0.023%

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.