

BMRGBOP
FONDO BBVA BANCOMER DE PROTECCIÓN DIARIA 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	%
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADO					
IQ	BPAG91	190822	mxAAA	501,812,990.57	4.26
IQ	BPAG91	200423	mxAAA	1,000,194,957.02	8.49
IQ	BPAG91	201224	mxAAA	2,289,616,273.70	19.44
IS	BPA182	190704	mxAAA	1,326,819,539.72	11.26
LD	BONDESD	190606	mxAAA	733,778.36	.01
LD	BONDESD	190606	mxAAA	2,500,487,415.58	21.23
M	BONOS	191211	mxAAA	776,731,373.23	6.59
M	BONOS	191211	mxAAA	2,500,487,471.71	21.23
M	BONOS	200611	mxAAA	850,320,466.88	7.22
M	BONOS	220609	mxAAA	31,671,992.04	.27
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				11,778,876,258.81	100.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				11,778,876,258.81	100.00

CLASIFICACIÓN

105

VaR Promedio última semana

0.000620%

CALIFICACIÓN

AAA/1

Límite de VaR

0.002%

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.