

## F-PYME

### FONDO BBVA BANCOMER DEUDA EMPRESAS 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	%
<b>DISPONIBILIDADES</b>					
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>					
CHD	BACOMER	0731625		.00	.00
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
IM	BPAG28	190725	mxAAA	149,695,980.00	.78
IM	BPAG28	191121	mxAAA	600,973,356.00	3.15
IQ	BPAG91	181018	mxAAA	135,659,205.00	.71
IS	BPA182	180104	mxAAA	576,031,925.41	3.02
IS	BPA182	180705	mxAAA	202,904,810.72	1.06
IS	BPA182	190103	mxAAA	307,757,628.00	1.61
LD	BONDESD	180215	mxAAA	291,200,837.80	1.53
LD	BONDESD	180328	mxAAA	610,646,506.79	3.20
LD	BONDESD	180405	mxAAA	303,115,306.13	1.59
LD	BONDESD	180419	mxAAA	2,630,492,124.77	13.79
LD	BONDESD	180614	mxAAA	152,399,467.61	.80
LD	BONDESD	180628	mxAAA	835,844,014.24	4.38
LD	BONDESD	181011	mxAAA	300,257,025.00	1.57
LD	BONDESD	181213	mxAAA	199,829,366.00	1.05
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>					
F	BACOMER	17084	mxA-1+	601,115,766.00	3.15
F	BACOMER	17094	mxA-1+	351,738,957.50	1.84
F	BACOMER	17116	mxA-1+	200,041,536.00	1.05
F	BANAMEX	7432	mxA-1+	702,029,489.00	3.68
F	BANAMEX	7438	mxA-1+	60,111,576.60	.32
F	BSCTIA	17005	mxA-1+	200,041,702.00	1.05
F	BSCTIA	17012	mxA-1+	115,599,233.95	.61
F	BSCTIA	17013	mxA-1+	115,599,233.95	.61
F	BSCTIA	17032	mxA-1+	391,693,680.30	2.05
F	HSBCMX	17004	mxA-1+	553,348,449.50	2.90
I	BACMEXT	17504	mxA-1+	1,310,301,320.01	6.87
<b>PAPEL PRIVADO</b>					
91	METROCB	07	mxD	287,230.02	.00
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>				11,898,715,728.30	62.36
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				11,898,715,728.30	62.36
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>					
<b>REPORTADO</b>					
IM	BPAG28	200514	mxAAA	1,278,262,519.61	6.70
IQ	BPAG91	200820	mxAAA	1,288,848,517.11	6.75
IS	BPA182	230309	mxAAA	2,138,352,204.01	11.21
LD	BONDESD	190808	mxAAA	1,168,065,358.76	6.12
LD	BONDESD	200730	mxAAA	1,308,712,623.36	6.86
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>				7,182,241,222.85	37.64
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>				19,080,956,951.15	100.00

**CLASIFICACIÓN****101****VaR Promedio última semana****0.003843%****CALIFICACIÓN****AAA/1****Límite de VaR****0.026%**

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 simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto.