

BBVAUDI

FONDO BBVA BANCOMER DEUDA 14, S.A. DE C.V FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	0661112		3,103.46	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				3,103.46	.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
BI	CETES	220210	mxAAA	27,196,442.00	5.04
S	UDIBONO	220609	mxAAA	1,928,871.61	.36
S	UDIBONO	231116	mxAAA	91,669,056.28	17.00
S	UDIBONO	251204	mxAAA	105,885,269.42	19.63
S	UDIBONO	281130	mxAAA	191,849,618.64	35.57
TÍTULOS BANCARIOS					
94	BACOMER	07U	Aaa.mx	104,205,381.36	19.32
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				522,734,639.31	96.93
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				522,734,639.31	96.93
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IM	BPAG28	220210	mxAAA	16,547,779.19	3.07
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				16,547,779.19	3.07
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				539,285,521.96	100.00

CATEGORÍA

127

CALIFICACIÓN

AA/6 MOO

VaR Promedio última semana

0.412568%

Límite de VaR

0.950%

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.