

**BMERGOB**  
FONDO BBVA BANCOMER DEUDA CAJA, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN  
INSTRUMENTOS DE DEUDA  
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
IM	BPAG28	190725	mxAAA	1,236,873,193.01	1.79
IM	BPAG28	191121	mxAAA	1,100,046,904.00	1.59
IM	BPAG28	200220	mxAAA	150,719,290.50	.22
IM	BPAG28	200813	mxAAA	501,375,300.00	.72
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	508,778,150.00	.73
IS	BPA182	200130	mxAAA	401,170,703.70	.58
LD	BONDESD	190627	mxAAA	1,769,948,778.06	2.55
LD	BONDESD	190808	mxAAA	3,863,401,000.94	5.58
LD	BONDESD	191003	mxAAA	4,314,137,338.20	6.23
LD	BONDESD	191024	mxAAA	712,036,770.09	1.03
LD	BONDESD	191205	mxAAA	2,247,633,807.00	3.24
LD	BONDESD	191226	mxAAA	1,762,121,998.15	2.54
LD	BONDESD	200130	mxAAA	3,009,685,830.00	4.34
LD	BONDESD	200402	mxAAA	2,941,420,049.21	4.25
LD	BONDESD	200528	mxAAA	2,072,929,464.00	2.99
LD	BONDESD	200702	mxAAA	85,870,787.13	.12
LD	BONDESD	200730	mxAAA	299,902,941.00	.43
LD	BONDESD	200924	mxAAA	419,903,275.50	.61
LD	BONDESD	201126	mxAAA	502,143,400.00	.72
LD	BONDESD	210121	mxAAA	251,052,052.50	.36
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>				28,151,151,032.99	40.64
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				28,151,151,032.99	40.64
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADO</b>					
BI	CETES	190718	mxAAA	1,704,371,430.31	2.46
IM	BPAG28	220210	mxAAA	498,790,557.31	.72
IM	BPAG28	220512	mxAAA	1,223,213,169.26	1.77
IQ	BPAG91	200820	mxAAA	3,275,949,836.48	4.73
IQ	BPAG91	230831	mxAAA	2,925,174,558.59	4.22
IQ	BPAG91	240502	mxAAA	349,487,217.88	.50
IS	BPA182	200730	mxAAA	2,272,168,206.56	3.28
IS	BPA182	210311	mxAAA	464,359,279.00	.67
IS	BPA182	210311	mxAAA	778,792,791.44	1.12
IS	BPA182	220310	mxAAA	475,533,140.98	.69
IS	BPA182	230309	mxAAA	509,851,446.09	.74
IS	BPA182	240307	mxAAA	3,163,908,581.28	4.57
IS	BPA182	250306	mxAAA	765,994,100.86	1.11
IS	BPA182	250306	mxAAA	2,043,006,106.31	2.95
IS	BPA182	260219	mxAAA	3,659,523,643.14	5.28
LD	BONDESD	200730	mxAAA	173,384,719.04	.25
LD	BONDESD	210520	mxAAA	1,671,443,388.58	2.41
LD	BONDESD	220714	mxAAA	1,548,207,399.96	2.23
LD	BONDESD	230309	mxAAA	1,612,825,859.41	2.33
LD	BONDESD	240229	mxAAA	2,266,688,804.64	3.27
LD	BONDESD	240425	mxAAA	3,854,593,928.43	5.56
LD	BONDESD	240425	mxAAA	579,770,234.73	.84

M	BONOS	220609	mxAAA	259,788,030.61	.38
M	BONOS	361120	mxAAA	872,193.56	.00
S	UDIBONO	190613	mxAAA	2,500,579,358.99	3.61
S	UDIBONO	190613	mxAAA	2,500,579,358.99	3.61
S	UDIBONO	190613	mxAAA	6,953,593.83	.01
S	UDIBONO	201210	mxAAA	16,344,550.78	.02
S	UDIBONO	220609	mxAAA	6,419,472.04	.01
S	UDIBONO	251204	mxAAA	17,465,540.21	.03
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>				41,126,040,499.29	59.36
<b>TOTAL DE INVERSION EN VALORES</b>				69,277,191,532.28	100.00

**CLASIFICACIÓN**

**108**

**VaR Promedio última semana**

**0.001471%**

**CALIFICACIÓN**

**AAA/1**

**Límite de VaR**

**0.020%**

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.