

B+PZO
FONDO BBVA BANCOMER DEUDA PLAZO, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 21 FEBRERO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	0659436		13,343.99	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				13,343.99	.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	200611	mxAAA	882,170,229.90	19.11
M	BONOS	210610	mxAAA	1,816,599,199.80	39.36
M	BONOS	211209	mxAAA	883,741,975.30	19.15
M	BONOS	220609	mxAAA	96,719,603.00	2.10
M	BONOS	270603	mxAAA	87,335,515.80	1.89
TÍTULOS BANCARIOS					
97	BACOMCB	07	mxAAA	1,028,105.00	.02
PAPEL PRIVADO					
AIM	BANDER	0000443		6,881,575.00	.15
EAIM	SANTCME	0000014		2,592,391.00	.06
JE	AMX	0619	mxAAA	20,079,738.52	.43
91	AC	11-2	mxAAA	49,997,519.00	1.08
91	AMX	10-2	mxAAA	50,128,077.39	1.09
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	50,320,096.00	1.09
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	60,467,624.40	1.31
91	GMXT	17-2	mxAAA	29,063,628.90	.63
91	LALA	18-2	AA(mex)	35,062,334.30	.76
91	LIVEPOL	10	mxAAA	46,849,468.32	1.01
91	LIVEPOL	12-2	mxAAA	45,563,583.79	.99
91	METROCB	03-3	D	56,100.00	.00
91	NRF	17	mxAAA	51,507,149.01	1.12
95	CFE	15	Aa1.mx	26,328,349.38	.57
95	CFECB	10-2	Aa1.mx	34,253,955.17	.74
95	PEMEX	13	Aa3.mx	30,157,332.60	.65
95	PEMEX	13-2	Aa3.mx	3,370,579.40	.07
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				4,310,274,130.98	93.38
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				4,310,274,130.98	93.38
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADO					
IS	BPA182	210909	mxAAA	81,452,568.92	1.76
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				81,452,568.92	1.76
OPERACIONES CON DERIVADOS					
CONTRATOS DE INTERCAMBIO (SWAPS)					
SWP	13X1	190823		74,400.00	.00
NOTAS ESTRUCTURADAS					
83	SCOTIAB	1-19		99,216,168.00	2.15
99	BACOMER	2-19		124,593,533.75	2.70
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				223,884,101.75	4.85
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				4,615,624,145.64	100.00

CLASIFICACIÓN

128

VaR Promedio última semana

0.159469%

CALIFICACIÓN

AA/4

Límite de VaR

0.670%

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.