

B+REAL

FONDO BBVA BANCOMER DEUDA 14, 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	%
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
S	UDIBONO	201210	mxAAA	198,504,293.47	26.19
S	UDIBONO	220609	mxAAA	158,931,070.41	20.97
S	UDIBONO	251204	mxAAA	96,240,623.71	12.70
S	UDIBONO	281130	mxAAA	116,189,777.03	15.33
TÍTULOS BANCARIOS					
94	BACOMER	07U	Aaa.mx	98,340,041.69	12.98
94	BACOMER	10U	Aaa.mx	51,494,456.04	6.79
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				719,700,262.35	94.96
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				719,700,262.35	94.96
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADO					
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	38,178,873.86	5.04
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				38,178,873.86	5.04
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				757,879,136.21	100.00

CLASIFICACIÓN

127

CALIFICACIÓN

AA/6

VaR Promedio última semana

0.245848%

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.