

**BBVAPC**  
**FONDO BBVA MÉXICO DEUDA 11, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA**  
**CARTERA DE VALORES AL 30 ENERO, 2025**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>DISPONIBILIDADES</b>					
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>					
CHD	BACOMER	1602926		28,399.05	.00
CHD	BBVAES	2646035		32,616.07	.00
CHE	BBVAES	1538071		11,876.13	.00
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>					
AIM	BANDER	0048368		5,266,831.00	.65
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>				5,339,722.25	.66
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					
<b>FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)</b>					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	69,121,319.65	8.50
<b>FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA</b>					
51	BBVALIQ	F	AAA/1	466,379,067.89	57.38
51	BBVAMRF	F	AA/4	69,006,959.61	8.49
51	BBVARF	F	AA/2	196,100,894.09	24.13
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>				800,608,241.24	98.50
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				800,608,241.24	98.50
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
M	BONOS	260305	mxAAA	6,412,702.74	.79
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>				6,412,702.74	.79
<b>OPERACIONES CON DERIVADOS</b>					
<b>FUTUROS</b>					
FD	DEUA	MR25		410,040.00	.05
<b>TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS</b>				410,040.00	.05
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>				812,770,706.23	100.00

**CATEGORÍA**

111

**VaR Promedio última semana**

0.033047%

**CALIFICACIÓN**

AA/3 MO

**Límite de VaR**

0.440%

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.

