

BBVAPCD

FONDO BBVA MÉXICO DEUDA 15, 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	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	8863180		16,753,596.56	7.90
CHD	BBVAES	3031036		1,077,387.89	.51
CHE	BBVAES	1545028		8,410.96	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				17,839,395.41	8.41
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	18,991,653.01	8.96
56SP	DBFRNIC	LX	NA	7,793,044.77	3.68
56SP	JPSDBAI	LX	NA	21,587,663.61	10.18
56SP	JPUSDGA	LX	NA	115,403,552.53	54.43
56SP	PFIUSMI	LX	NA	21,587,961.62	10.18
56SP	UBMSSIC	LX	NA	7,802,629.26	3.68
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				193,166,504.80	91.11
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				193,166,504.80	91.11
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
LF	BONDESF	321021	mxAAA	1,000,700.91	.47
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				1,000,700.91	.47
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				212,006,601.12	100.00

CATEGORÍA

111

CALIFICACIÓN

AA/7 MO

VaR Promedio última semana

1.421446%

Límite de VaR

2.300%

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.