

SB+PC
FONDO BBVA BANCOMER DEUDA 16, S.A. de C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	BBVAGUB	FS	AAA/1	1,041,472.68	51.09
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				1,041,472.68	51.09
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				1,041,472.68	51.09
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
LD	BONDESD	260806	mxAAA	997,112.94	48.91
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				997,112.94	48.91
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				2,038,585.62	100.00

CATEGORÍA
111

CALIFICACIÓN
AA/6 MO

VaR Promedio Mes
0.000415%

Límite de VaR
0.450%

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.

