

BBVADGA

FONDO BBVA MÉXICO DEUDA 21, S.A DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	260903	mxAAA	11,202,597.78	.58
M	BONOS	270603	mxAAA	15,047,323.83	.78
M	BONOS	290301	mxAAA	48,981,652.81	2.55
M	BONOS	290531	mxAAA	41,003,892.31	2.14
M	BONOS	310529	mxAAA	156,375,819.00	8.15
M	BONOS	330526	mxAAA	196,429,192.97	10.23
M	BONOS	341123	mxAAA	264,345,783.34	13.77
M	BONOS	381118	mxAAA	86,109,379.02	4.49
M	BONOS	421113	mxAAA	90,615,049.09	4.72
M	BONOS	471107	mxAAA	170,704,120.68	8.89
M	BONOS	530731	mxAAA	172,312,264.21	8.98
S	UDIBONO	251204	mxAAA	31,412,125.29	1.64
S	UDIBONO	261203	mxAAA	41,698,673.63	2.17
S	UDIBONO	281130	mxAAA	42,704,052.20	2.22
S	UDIBONO	311127	mxAAA	52,397,793.20	2.73
S	UDIBONO	340824	mxAAA	227,825,742.72	11.87
S	UDIBONO	501103	mxAAA	12,631,824.77	.66
S	UDIBONO	541029	mxAAA	95,742,448.40	4.99
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				1,757,539,735.25	91.55
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				1,757,539,735.25	91.55
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
LD	BONDESD	250619	mxAAA	162,146,127.37	8.45
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				162,146,127.37	8.45
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				1,919,685,862.62	100.00

CATEGORÍA

111

CALIFICACIÓN

AAA/5 MO

VaR Promedio Mes

0.673913%

Límite de VaR

2.100%

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.