

BMERINF

FONDO BBVA BANCOMER SELECCIÓN ESTRATEGICA,S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE

CARTERA DE VALORES AL 03 DICIEMBRE, 2020

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Valor Razonable | % |
|---|---------|-------|-----------------------|-----------------|--------|
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | |
| INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | |
| EMPRESAS ENERGÉTICAS | | | | | |
| 1 | IENOVA | * | ALTA | 3,657,742.20 | 7.13 |
| 1ASP | PBR | N | ALTA | 2,297,784.85 | 4.48 |
| EMPRESAS MATERIALES | | | | | |
| 1 | CEMEX | CPO | ALTA | 4,722,721.56 | 9.20 |
| 1 | GCC | * | ALTA | 3,373,817.67 | 6.57 |
| 1 | GMEXICO | B | ALTA | 4,771,498.69 | 9.30 |
| 1ASP | GGB | N | ALTA | 5,136,224.96 | 10.01 |
| 1ASP | VALE | N | ALTA | 6,612,509.37 | 12.88 |
| EMPRESAS INDUSTRIALES | | | | | |
| 1 | ASUR | B | ALTA | 1,660,403.16 | 3.24 |
| 1 | OMA | B | ALTA | 2,080,032.60 | 4.05 |
| 1 | ORBIA | * | ALTA | 1,630,967.52 | 3.18 |
| 1 | PINFRA | * | ALTA | 1,499,197.58 | 2.92 |
| 1 | PINFRA | L | MEDIA | 1,109,434.00 | 2.16 |
| 1 | VESTA | * | ALTA | 4,373,634.00 | 8.52 |
| 1 | VOLAR | A | ALTA | 1,646,855.46 | 3.21 |
| 1ASP | AZULB | N | NA | 1,384,083.67 | 2.70 |
| 1ASP | ERJ | N | ALTA | 97,614.29 | .19 |
| EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN | | | | | |
| 1 | SITES | B-1 | ALTA | 4,404,440.64 | 8.58 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS PÚBLICOS | | | | | |
| 1ASP | CIG | N | ALTA | 205,895.74 | .40 |
| 1ASP | SBS | N | NA | 469,569.62 | .91 |
| TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | 51,134,427.58 | 99.63 |
| INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | |
| TÍTULOS BANCARIOS | | | | | |
| I | BACMEXT | 20485 | mxA-1+ | 190,744.00 | .37 |
| TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | 190,744.00 | .37 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | 51,325,171.58 | 100.00 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | 51,325,171.58 | 100.00 |

CATEGORÍA

206

VaR Promedio última semana

3.073613%

CALIFICACIÓN

NA

Límite de VaR

5.660%

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.