

BBVALAT

FONDO BBVA BANCOMER RV2, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE

CARTERA DE VALORES AL 30 NOVIEMBRE, 2020

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	7184301		.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS ENERGÉTICAS					
1	IENOVA	*	ALTA	329,332.50	3.59
1ASP	PBR	N	ALTA	118,626.20	1.29
EMPRESAS MATERIALES					
1	GCC	*	ALTA	481,890.92	5.25
EMPRESAS INDUSTRIALES					
1	OMA	B	ALTA	238,378.47	2.60
1	PINFRA	*	ALTA	330,767.50	3.60
1	VESTA	*	ALTA	152,733.75	1.66
1ASP	AZULB	N	NA	317,243.54	3.46
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1	HCITY	*	MEDIA	257,842.00	2.81
1ASP	MELI	N	ALTA	594,854.71	6.48
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1	AC	*	ALTA	337,280.40	3.67
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
1ASP	GGAL	N	NA	75,836.48	.83
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	EPU	*	ALTA	82,129.63	.89
1ISP	EWZ	*	ALTA	5,837,183.97	63.58
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				9,154,100.07	99.71
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
TÍTULOS BANCARIOS					
I	BACMEXT	20482	mxA-1+	26,780.00	.29
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				26,780.00	.29
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				9,180,880.07	100.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				9,180,880.07	100.00

CATEGORÍA

209

VaR Promedio Mes

3.131208%

CALIFICACIÓN

NA

Límite de VaR

5.500%

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.