

B+CAPRI

FONDO BBVA BANCOMER RV10, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 29 DICIEMBRE, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHE	BBVAES	1544841		219,133.11	.12
TOTAL DISPONIBILIDADES				219,133.11	.12
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BBVCP16	SM	NA	168,023,998.78	91.59
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				168,023,998.78	91.59
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				168,023,998.78	91.59
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADO					
LD	BONDESD	180215	mxAAA	15,208,283.26	8.29
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				15,208,283.26	8.29
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				183,451,415.15	100.00

CLASIFICACIÓN
209

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio Mes
1.730639%

Límite de VaR
2.259%

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 simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto.