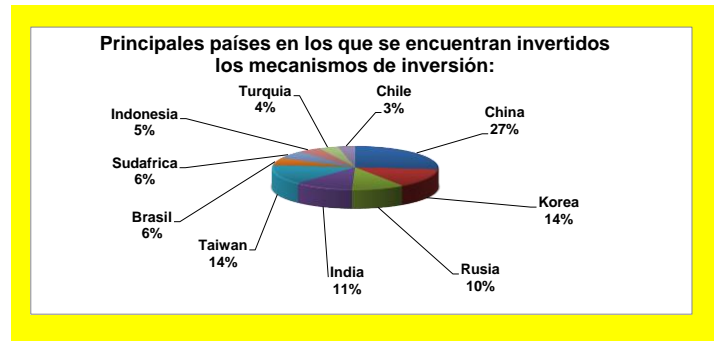




BBVAEMG
FONDO BBVA BANCOMER RV1, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSION DE RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 18 ENERO, 2018

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	7182821		106,427.97	0.04
TOTAL DISPONIBILIDADES				106,427.97	0.04
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS ENERGÉTICAS					
1ASP	LKOD	N	NA	6,506,353.83	2.44
1ASP	OGZD	N	NA	5,591,194.98	2.09
1ASP	SNP	N	NA	4,151,059.94	1.56
EMPRESAS MATERIALES					
1	PE&OLES	*	ALTA	3,927,711.48	1.47
1ASP	BAK	N	NA	4,003,050.12	1.50
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1ASP	EDU	N	NA	3,695,262.82	1.38
1ASP	YUMC	*	NA	4,485,784.79	1.68
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1	GRUMA	B	ALTA	3,711,935.28	1.39
1	WALMEX	*	ALTA	4,496,933.32	1.68
1ASP	CCU	N	NA	4,081,931.52	1.53
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
1ASP	BSBR	N	ALTA	4,233,368.72	1.59
1ASP	KB	N	NA	4,558,667.57	1.71
1ASP	SHG	N	NA	3,983,932.41	1.49
1B	MEXTRAC	09	MEDIA	828,452.80	0.31
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	ECH	*	ALTA	4,293,558.61	1.61
1ISP	EIDO	*	NA	11,199,408.64	4.20
1ISP	EPHE	*	NA	7,977,087.30	2.99
1ISP	EWM	*	ALTA	855,169.49	0.32
1ISP	EWY	*	ALTA	29,309,783.90	10.98
1ISP	EWZ	*	ALTA	19,064,284.93	7.14
1ISP	EWZ	*	ALTA	5,202,609.73	1.95
1ISP	EZA	*	ALTA	14,363,387.93	5.38
1ISP	INDA	*	NA	27,410,570.15	10.27
1ISP	MCHI	*	NA	51,409,127.34	19.26
1ISP	THD	*	ALTA	725,216.97	0.27
1ISP	TUR	*	ALTA	9,292,780.22	3.48
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN					
1ASP	NTES	N	NA	4,601,369.37	1.72
1ASP	SMSN	N	NA	6,147,858.50	2.30
1ASP	TSM	N	ALTA	5,537,048.76	2.07
1ASP	YY	N	NA	5,559,259.82	2.08
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				261,204,161.24	97.85
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
TÍTULOS BANCARIOS					
I	NAFIN	18035	mxA-1+	5,639,333.00	2.11
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				5,639,333.00	2.11
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				266,843,494.24	99.96
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				266,949,922.21	100.00



CLASIFICACIÓN
209

CLASIFICACIÓN
NA

VaR Promedio última semana
1.455049%

Límite de VaR
4.670%

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.