

BBVAE50
FONDO BBVA BANCOMER EUROTOP, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 10 DICIEMBRE, 2020

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	1473816		12,026.92	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				12,026.92	.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS ENERGÉTICAS					
1ASP	TOT	N	ALTA	28,242,444.86	3.93
EMPRESAS MATERIALES					
1ASP	AI	N	NA	17,730,930.34	2.47
1ASP	BAS	N	NA	16,331,179.12	2.27
1ASP	CRH	N	NA	7,424,682.51	1.03
1ASP	LIN	N	NA	31,647,375.72	4.40
EMPRESAS INDUSTRIALES					
1ASP	AIR	N	NA	15,228,407.71	2.12
1ASP	DG	N	NA	13,274,603.54	1.85
1ASP	DPW	N	NA	10,917,723.33	1.52
1ASP	SAF	N	NA	11,889,303.07	1.65
1ASP	SIE	N	NA	23,390,078.01	3.26
1ASP	SU	N	NA	17,430,954.84	2.43
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1ASP	ADS	N	NA	14,509,456.18	2.02
1ASP	ALV	N	NA	22,819,205.38	3.18
1ASP	DAI	N	ALTA	12,975,234.37	1.81
1ASP	ITX	N	NA	8,957,937.53	1.25
1ASP	KER	N	NA	12,408,539.45	1.73
1ASP	MC	N	NA	36,608,048.45	5.09
1ASP	PHIA	N	NA	11,011,518.15	1.53
1ASP	VOW3	N	NA	7,345,406.01	1.02
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1ASP	AD	N	NA	7,850,616.75	1.09
1ASP	BN	N	NA	9,189,333.18	1.28
1ASP	OR	N	NA	20,484,159.19	2.85
1E	ANB	*	BAJA	13,970,711.00	1.94
EMPRESAS DE SALUD					
1ASP	BAYN	N	NA	12,881,945.32	1.79
1ASP	ELU	N	NA	10,847,232.69	1.51
1ASP	SNY	N	ALTA	25,624,431.75	3.57
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
1ASP	AXA	N	ALTA	11,998,326.20	1.67
1ASP	BNP	N	NA	14,056,976.30	1.96
1ASP	DB1	N	NA	7,543,537.82	1.05
1ASP	ING	N	ALTA	9,079,765.23	1.26
1ASP	ISP	N	NA	10,156,990.18	1.41
1ASP	MUV2	N	NA	9,753,673.25	1.36
1ESP	SAN	*	MEDIA	12,872,334.60	1.79
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	FEZ	*	ALTA	79,590,443.27	11.08
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN					
1ASP	ADYEN	N	NA	13,704,114.97	1.91

1ASP	ASML	N	NA	41,324,737.25	5.75
1ASP	NOK	N	ALTA	5,686,490.68	.79
1ASP	SAP	N	ALTA	29,899,936.05	4.16
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES					
1ASP	DTE	N	NA	13,407,023.15	1.87
EMPRESAS DE SERVICIOS PÚBLICOS					
1ASP	ENEL	N	NA	17,827,410.17	2.48
1ASP	IBE	N	NA	18,357,065.52	2.55
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				716,250,283.09	99.69
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
TÍTULOS BANCARIOS					
I	BACMEXT	20495	mxA-1+	2,241,250.00	.31
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				2,241,250.00	.31
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				718,491,533.09	100.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				718,503,560.01	100.00

CATEGORÍA

209

CALIFICACIÓN

NA

VaR Promedio última semana

2.175293%

Límite de VaR

5.010%

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.