

BBVAUS
FONDO BBVA BANCOMER DIVERSIFICADO INTERNACIONAL, S.A. DE C.V. FONDO DE
INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 01 JULIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS ENERGÉTICAS					
1ASP	PXD	*	NA	13,306,592.10	.30
EMPRESAS MATERIALES					
1ASP	CCK	*	NA	21,287,593.66	.48
1ASP	EMN	*	NA	54,147,242.40	1.22
1ASP	PPG	*	NA	54,845,734.24	1.24
EMPRESAS INDUSTRIALES					
1ASP	DE	*	NA	33,599,287.01	.76
1ASP	NOC	*	NA	49,735,572.65	1.12
1ASP	NSC	*	NA	139,151,439.03	3.14
1ASP	PLD	*	ALTA	126,667,175.58	2.86
1ASP	SWK	*	NA	26,165,756.48	.59
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1ASP	AMZN	*	ALTA	238,886,942.22	5.39
1ASP	ETN1	N	NA	142,663,921.12	3.22
1ASP	LOW	*	NA	78,553,266.43	1.77
1ASP	MAR	*	NA	77,677,696.62	1.75
1ASP	MCD	*	ALTA	109,379,781.84	2.47
1ASP	NFLX	*	NA	9,361,800.96	.21
1ASP	ORLY	*	NA	38,392,237.69	.87
1ASP	ROST	*	NA	37,956,192.64	.86
1ASP	TSLA	*	NA	83,388,302.09	1.88
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1ASP	KO	*	ALTA	125,889,465.25	2.84
1ASP	YUM	*	NA	28,621,115.09	.65
EMPRESAS DE SALUD					
1ASP	ABBV	*	NA	110,626,867.92	2.50
1ASP	BIIB	*	NA	39,044,827.52	.88
1ASP	BMJ	*	ALTA	81,039,223.12	1.83
1ASP	BSX	*	NA	65,055,714.75	1.47
1ASP	ISRG	*	NA	46,761,512.99	1.06
1ASP	LLY	*	ALTA	62,502,491.25	1.41
1ASP	REGN	*	NA	31,236,560.12	.71
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
1ASP	AMP	*	NA	52,280,735.73	1.18
1ASP	CI	*	NA	71,531,112.11	1.61
1ASP	MA	*	NA	169,470,583.45	3.83
1ASP	MS	*	ALTA	112,424,328.92	2.54
1ASP	PGR	*	NA	41,724,143.89	.94
1ASP	SIVB	*	NA	19,032,292.83	.43
1ASP	TFC	*	NA	128,701,627.02	2.91
1ASP	USB	*	NA	120,694,920.83	2.72
1ASP	V	*	ALTA	36,993,556.38	.83
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN					
1ASP	AAPL	*	ALTA	253,110,945.02	5.71
1ASP	ADI	*	NA	138,361,874.85	3.12
1ASP	AFRM	*	NA	14,264,594.42	.32

1ASP	AMD	*	ALTA	51,479,762.67	1.16
1ASP	CDAY	*	NA	22,428,948.50	.51
1ASP	FB	*	NA	59,361,313.75	1.34
1ASP	FLT	*	NA	45,034,386.56	1.02
1ASP	GOOGL	*	NA	311,370,639.22	7.03
1ASP	LDOS	*	NA	65,046,616.34	1.47
1ASP	LRCX	*	NA	82,849,274.23	1.87
1ASP	MSFT	*	ALTA	316,820,659.21	7.15
1ASP	NXPI	N	NA	64,986,946.17	1.47
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES					
1ASP	CHTR	*	NA	26,976,560.42	.61
1ASP	SPGI	*	NA	67,873,563.05	1.53
EMPRESAS DE SERVICIOS PÚBLICOS					
1ASP	NEE	*	NA	104,252,289.15	2.35
1ASP	XEL	*	NA	76,103,556.34	1.72
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				4,379,119,543.83	98.85
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
TÍTULOS BANCARIOS					
I	BACMEXT	21265	mxA-1+	51,037,074.00	1.15
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				51,037,074.00	1.15
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				4,430,156,617.83	100.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				4,430,156,617.83	100.00

CATEGORÍA

209

CALIFICACIÓN

NA

VaR Promedio última semana

2.624725%

Límite de VaR

5.050%

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.