

BBVAGF

FONDO BBVA MÉXICO RV7, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 30 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	3512754		822,027.64	.01
CHD	BBVAES	2644039		2,176.12	.00
CHE	BBVAES	1535775		570,171.88	.01
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0022037		305,873,914.00	2.74
AIM	SANTCME	0000003		2,771,985.00	.02
EAIM	SANTCME	0000003		2,021,587.00	.02
TOTAL DISPONIBILIDADES				312,061,861.64	2.79
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BLEAI2E	LX	NA	157,720,498.23	1.41
56SP	BSADI2U	LX	NA	332,765,864.68	2.98
56SP	LUMNUUB	LX	NA	315,926,237.08	2.83
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
11SP	EMBMXX	N	ALTA	416,699,780.00	3.73
11SP	EMCA	N	ALTA	168,809,253.98	1.51
11SP	IBTMXX	N	ALTA	537,859,305.50	4.81
11SP	IDTP	N	ALTA	441,784,939.42	3.95
11SP	IDTXX	N	ALTA	268,379,490.50	2.40
11SP	LQDA	N	ALTA	248,768,092.33	2.23
11SP	SDMXX	N	ALTA	538,862,799.90	4.82
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	BBVADGA	F	AAA/5	541,877,860.38	4.85
51	BBVADLP	F	AA/5	875,864,949.46	7.84
51	BBVAGB3	F	AAA/5	774,809,219.28	6.94
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVAC+	F	NA	430,115,504.00	3.85
52	BBVACRE	F	NA	1,621,796,804.37	14.52
52	BBVAGL4	F	NA	1,565,736,198.99	14.02
52	BBVAMLT	F	NA	1,557,836,895.97	13.94
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				10,795,613,694.07	96.63
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				10,795,613,694.07	96.63
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
BI	CETES	251224	mxAAA	45,617,672.72	.41
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				45,617,672.72	.41
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FCSP	EC	H5		-173,245.11	-.00
FD	DEUA	MR25		18,613,368.00	.17
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				18,440,122.89	.17
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				11,171,733,351.32	100.00

CATEGORÍA
205

CALIFICACIÓN
N/A

VaR Promedio última semana
0.434625%

Límite de VaR
0.820%

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.

