

BBVACR

FONDO BBVA MÉXICO RV8, 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	3512967		1,090,050.78	.02
CHD	BBVAES	2643036		65,914.41	.00
CHE	BBVAES	1535782		643,803.68	.01
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0090513		86,284,501.00	1.64
AIM	SANTCME	0000004		19,007,995.00	.36
AIM	SANTCME	0000104		28,742,331.00	.55
EAIM	SANTCME	0000004		8,179,401.00	.16
EAIM	SANTCME	0000104		2,409,263.00	.05
TOTAL DISPONIBILIDADES				146,423,259.87	2.78
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	AQSCU3M	LX	NA	427,986,321.84	8.13
56SP	BEBECMH	LX	NA	47,918,585.88	.91
56SP	LXWDIUA	ID	NA	442,174,811.51	8.40
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
11SP	CSPXX	N	ALTA	677,848,754.50	12.88
11SP	EIMI	N	ALTA	222,308,560.59	4.22
11SP	IJPD	N	ALTA	114,395,965.34	2.17
11SP	IMEAX	N	ALTA	311,221,768.00	5.91
11SP	IUFS	N	ALTA	61,744,356.66	1.17
11SP	IUIT	N	ALTA	57,564,478.66	1.09
11SP	IUUS	N	ALTA	59,362,202.73	1.13
11SP	TLT	*	ALTA	155,819,083.25	2.96
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	BBVADLP	F	AA/5	262,735,554.41	4.99
51	BBVAGLP	F	AAA/5	766,981,113.79	14.57
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVAC+	F	NA	423,115,584.15	8.04
52	BBVADIG	F	NA	30,772,879.07	.58
52	BBVARV	F	NA	267,829,949.63	5.09
52	BBVAUS	F	NA	752,615,915.49	14.30
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				5,082,395,885.50	96.55
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				5,082,395,885.50	96.55
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
M	BONOS	260305	mxAAA	28,005,654.71	.53
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				28,005,654.71	.53
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FCSP	EC	H5		-111,581.60	-.00
FCSP	ES	H5		97,285.02	.00
FCSP	ES	H5		680,995.11	.01
FCSP	JY	H5		731,917.67	.01
FCSP	PE	H5		-554,557.29	-.01
FCSP	PE	H5		-229,788.93	-.00
FCSP	ZWP	H5		441,638.23	.01

FCSP	ZWP	H5	1,118,190.40	.02
FD	DEUA	MR25	6,918,048.00	.13
FI	IPC	MR25	-1,743,300.00	-.03
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS			7,348,846.61	.14
TOTAL DE INVERSION EN VALORES			5,264,173,646.69	100.00

CATEGORÍA
205

CALIFICACIÓN
N/A

VaR Promedio última semana
0.654769%

Límite de VaR
2.600%

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.

