

BBVAGL4

FONDO BBVA MÉXICO RV9, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 04 JUNIO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	6946887		32,860.36	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0021874		382,512.00	.01
TOTAL DISPONIBILIDADES				415,372.36	.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	AGG	*	ALTA	405,907,440.63	6.03
1ISP	CNDX	N	ALTA	321,309,877.33	4.77
1ISP	CSPXX	N	ALTA	2,106,669,268.80	31.30
1ISP	DTMXX	N	ALTA	63,618,362.50	.95
1ISP	EIMI	N	ALTA	208,717,734.50	3.10
1ISP	EMCA	N	ALTA	59,039,785.33	.88
1ISP	EUFN	*	ALTA	136,491,068.78	2.03
1ISP	EWT	*	ALTA	94,708,931.45	1.41
1ISP	EWY	*	ALTA	73,081,609.11	1.09
1ISP	EWZ	*	ALTA	71,080,930.43	1.06
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	262,283,400.50	3.90
1ISP	IDTP	N	ALTA	88,413,062.70	1.31
1ISP	IHF	*	ALTA	100,031,388.37	1.49
1ISP	IJPAX	N	ALTA	243,737,874.00	3.62
1ISP	IMEAX	N	ALTA	487,566,158.80	7.24
1ISP	IWM	*	ALTA	64,042,709.46	.95
1ISP	JPEA	N	ALTA	166,102,668.44	2.47
1ISP	KRE	*	ALTA	135,343,911.72	2.01
1ISP	LEMB	*	ALTA	53,996,694.47	.80
1ISP	LQDMX	N	ALTA	218,791,536.00	3.25
1ISP	MCHI	*	ALTA	62,408,498.04	.93
1ISP	RSP	*	ALTA	144,106,439.31	2.14
1ISP	VUAA	N	ALTA	350,445,990.79	5.21
1ISP	XLI	*	ALTA	122,330,507.08	1.82
1ISP	XOP	*	ALTA	28,141,022.18	.42
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				6,068,366,870.72	90.17
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	290301	mxAAA	432,276,619.68	6.42
M	BONOS	421113	mxAAA	5,117.84	.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				432,281,737.52	6.42
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				6,500,648,608.24	96.59
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
M	BONOS	300228	mxAAA	229,004,986.07	3.40
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				229,004,986.07	3.40
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	JN26		18,073.00	.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				18,073.00	.00



Creando Oportunidades

TOTAL DE INVERSION EN VALORES

6,730,087,039.67

100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio última semana

1.063934%

Límite de VaR

2.370%

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.