

BBVAGL4

FONDO BBVA MÉXICO RV9, 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	6946887		26,566.73	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0021874		27,937,787.00	.55
TOTAL DISPONIBILIDADES				27,964,353.73	.55
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	CSPXX	N	ALTA	1,540,671,510.00	30.11
1ISP	EIMI	N	ALTA	362,450,728.79	7.08
1ISP	EMCA	N	ALTA	36,862,565.93	.72
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	194,208,323.00	3.80
1ISP	IDTXX	N	ALTA	230,085,410.50	4.50
1ISP	IHYMXX	N	ALTA	101,989,471.65	1.99
1ISP	IJPAX	N	ALTA	221,712,442.80	4.33
1ISP	IMEAX	N	ALTA	485,142,944.00	9.48
1ISP	JPEA	N	ALTA	56,002,120.35	1.09
1ISP	LEMB	*	ALTA	36,032,490.71	.70
1ISP	LQDMX	N	ALTA	487,417,749.00	9.53
1ISP	VUAA	N	ALTA	1,039,374,422.64	20.32
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				4,791,950,179.37	93.66
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	290301	mxAAA	256,567,138.31	5.01
M	BONOS	421113	mxAAA	25,983,367.45	.51
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				282,550,505.76	5.52
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				5,074,500,685.13	99.19
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
BI	CETES	251224	mxAAA	11,489,184.97	.22
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				11,489,184.97	.22
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	MR25		1,793,160.00	.04
FD	DEUA	MR25		381,888.00	.01
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				2,175,048.00	.04
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				5,116,129,271.83	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio última semana

1.101308%

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.