

## BBVAMLT

### FONDO BBVA MÉXICO RENTABILIDAD, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 29 MAYO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>DISPONIBILIDADES</b>					
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>					
CHD	BACOMER	2042401		28,114,378.75	.82
CHD	BBVAES	3155037		138,057.89	.00
CHE	BACOMER	5431670		78,733.90	.00
CHE	BBVAES	1552396		14,590.32	.00
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>					
AIM	SANTCME	0000028		12,520,246.00	.36
AIM	SANTCME	0000128		35,029,821.00	1.02
EAIM	SANTCME	0000028		40,348,750.00	1.17
EAIM	SANTCME	0000128		1,433,125.00	.04
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>				117,677,702.86	3.41
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					
<b>FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)</b>					
56SP	AQSCU3U	LX	NA	142,586,487.45	4.14
56SP	BEBEBUH	LX	NA	29,422,072.75	.85
<b>TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)</b>					
11SP	EIMI	N	ALTA	160,059,858.60	4.64
11SP	EMB	*	ALTA	9,706,574.42	.28
11SP	EMCA	N	ALTA	6,226,784.24	.18
11SP	EWC	*	ALTA	44,676,179.82	1.30
11SP	IEI	*	ALTA	552,814,444.22	16.04
11SP	IJPD	N	ALTA	148,406,024.77	4.31
11SP	JPEA	N	ALTA	41,202,989.25	1.20
11SP	LQDA	N	ALTA	504,937,624.11	14.65
11SP	VDCA	N	ALTA	103,042,398.04	2.99
11SP	VECP	N	ALTA	54,232,322.73	1.57
11SP	VGK	*	ALTA	226,686,914.19	6.58
11SP	VUAA	N	ALTA	977,687,654.56	28.37
11SP	ZPR1	N	ALTA	183,893,151.52	5.34
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>				3,185,581,480.67	92.42
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				3,185,581,480.67	92.42
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
M	BONOS	310529	mxAAA	141,833,075.64	4.11
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>				141,833,075.64	4.11
<b>OPERACIONES CON DERIVADOS</b>					
<b>FUTUROS</b>					
FCSP	EC	M6		-218,159.60	-.01
FCSP	SXO	M6		1,012.15	.00
FCSP	UXY	U6		-4,605.96	-.00
FCSP	UXY	U6		-49,581.79	-.00
FCSP	ZWP	M6		137,506.99	.00
FCSP	ZWP	M6		95,197.15	.00
FCSP	ZWP	M6		126,929.53	.00
FCSP	ZWP	M6		21,154.92	.00
FCSP	ZWP	M6		137,506.99	.00
FCSP	ZWP	M6		1,438,534.70	.04
<b>TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS</b>				1,685,495.08	.05



Creando Oportunidades

**TOTAL DE INVERSION EN VALORES**

3,446,777,754.25

100.00

**CATEGORÍA**

**205**

**CALIFICACIÓN**

**N/A**

**VaR Promedio Mes**

**1.518810%**

**Límite de VaR**

**2.760%**

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.