

BBVAGL4

FONDO BBVA MÉXICO RV9, 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	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	6946887		32,958.85	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0021874		385,841.00	.01
TOTAL DISPONIBILIDADES				418,799.85	.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	AGG	*	ALTA	408,778,980.91	6.17
1ISP	CNDX	N	ALTA	321,833,032.84	4.85
1ISP	CSPXX	N	ALTA	2,110,771,925.80	31.83
1ISP	DTMXX	N	ALTA	63,544,687.50	.96
1ISP	EIMI	N	ALTA	209,457,555.35	3.16
1ISP	EMCA	N	ALTA	59,069,455.05	.89
1ISP	EUFN	*	ALTA	138,593,089.64	2.09
1ISP	EWG	*	ALTA	76,500,180.80	1.15
1ISP	EWT	*	ALTA	92,325,890.62	1.39
1ISP	EWY	*	ALTA	73,969,862.43	1.12
1ISP	EWZ	*	ALTA	73,611,092.46	1.11
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	261,930,888.00	3.95
1ISP	IDTP	N	ALTA	88,850,290.05	1.34
1ISP	IHF	*	ALTA	97,745,181.32	1.47
1ISP	JPAX	N	ALTA	241,106,130.00	3.64
1ISP	IMEAX	N	ALTA	390,860,948.40	5.89
1ISP	IWM	*	ALTA	63,887,777.39	.96
1ISP	JPEA	N	ALTA	166,526,666.93	2.51
1ISP	KRE	*	ALTA	135,033,259.71	2.04
1ISP	LEMB	*	ALTA	54,082,068.41	.82
1ISP	LQDMX	N	ALTA	219,196,920.00	3.31
1ISP	MCHI	*	ALTA	61,888,594.26	.93
1ISP	RSP	*	ALTA	143,168,738.70	2.16
1ISP	VUAA	N	ALTA	352,125,695.77	5.31
1ISP	XLI	*	ALTA	120,588,011.89	1.82
1ISP	XOP	*	ALTA	27,065,413.34	.41
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				6,052,512,337.57	91.28
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	290301	mxAAA	432,419,417.94	6.52
M	BONOS	421113	mxAAA	5,316.69	.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				432,424,734.63	6.52
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				6,484,937,072.20	97.80
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
M	BONOS	300228	mxAAA	145,250,406.28	2.19
M	BONOS	310529	mxAAA	26,473.90	.00
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				145,276,880.18	2.19
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	JN26		-6,045.00	-.00



Creando Oportunidades

TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS

-6,045.00

-00 **TOTAL DE INVERSION EN VALORES**

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

1.082913%

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.