

BBVAGFD

FONDO BBVA MÉXICO RV12, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE

CARTERA DE VALORES AL 31 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	8863695		112,199.59	.01
CHD	BBVAES	3029039		398,403.55	.03
CHE	BBVAES	1545073		205,657.31	.01
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	SANTCME	0000012		3,721,609.00	.26
EAIM	SANTCME	0000012		218,425.00	.02
TOTAL DISPONIBILIDADES				4,656,294.45	.32
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BLEAI2E	LX	NA	55,913,184.75	3.87
56SP	BSADI2U	LX	NA	68,426,144.33	4.74
56SP	LUMNUUB	LX	NA	50,999,449.96	3.53
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
11SP	EMCA	N	ALTA	47,702,251.14	3.30
11SP	IDTP	N	ALTA	69,102,419.28	4.79
11SP	IHYA	N	ALTA	64,872,753.21	4.49
11SP	IUAA	N	ALTA	330,799,880.63	22.91
11SP	JPEA	N	ALTA	90,625,684.60	6.28
11SP	LQDA	N	ALTA	98,929,695.50	6.85
11SP	SDIA	N	ALTA	137,036,177.27	9.49
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVACD+	F	NA	40,598,694.06	2.81
52	BBVAML	F	NA	383,043,105.93	26.53
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				1,438,049,440.66	99.61
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				1,438,049,440.66	99.61
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IQ	BPAG91	290111	mxAAA	169,591.96	.01
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				169,591.96	.01
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FCSP	EC	H5		285,093.40	.02
FCSP	UXY	H5		470,954.74	.03
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				756,048.14	.05
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				1,443,631,375.21	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

1.379311%

Límite de VaR

2.460%

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.

