

BBVACRD

FONDO BBVA MÉXICO RV11, 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	8863350		189,940.95	.02
CHD	BBVAES	3030033		530,607.09	.06
CHE	BBVAES	1545004		10,952.97	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	SANTCME	0000011		3,450,535.00	.42
AIM	SANTCME	0000111		4,673,826.00	.57
EAIM	SANTCME	0000011		1,550,289.00	.19
EAIM	SANTCME	0000111		6,377,223.00	.78
TOTAL DISPONIBILIDADES				16,783,374.01	2.05
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	AQSCU3U	LX	NA	92,879,331.36	11.36
56SP	BEBEBUH	LX	NA	48,967,825.54	5.99
56SP	LXWDIUA	ID	NA	81,722,300.32	10.00
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
11SP	EIMI	N	ALTA	50,890,509.61	6.23
11SP	EUNK	N	ALTA	63,281,317.73	7.74
11SP	IJPD	N	ALTA	24,117,496.65	2.95
11SP	IUFS	N	ALTA	9,759,204.51	1.19
11SP	IUIT	N	ALTA	9,020,565.76	1.10
11SP	IUUS	N	ALTA	9,382,673.30	1.15
11SP	TLT	*	ALTA	36,081,930.90	4.41
11SP	VUAA	N	ALTA	186,101,180.33	22.77
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVACD+	F	NA	19,617,920.59	2.40
52	BBVADIG	F	NA	6,036,715.53	.74
52	BBVAUS	F	NA	154,276,374.88	18.88
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				792,135,347.01	96.92
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				792,135,347.01	96.92
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
LF	BONDESF	260604	mxAAA	7,938,150.25	.97
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				7,938,150.25	.97
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FCSP	EC	H5		-44,045.37	-.01
FCSP	EC	H5		-5,872.72	-.00
FCSP	EC	H5		-20,554.50	-.00
FCSP	EC	H5		-20,554.50	-.00
FCSP	ES	H5		162,141.69	.02
FCSP	JY	H5		139,412.89	.02
FCSP	ZWP	H5		46,982.79	.01
FCSP	ZWP	H5		206,724.28	.03
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				464,234.56	.06
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				817,321,105.83	100.00

CATEGORÍA
205

CALIFICACIÓN
N/A

VaR Promedio última semana
1.410274%

Límite de VaR
4.650%

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.

