

BBVAA

FONDO BBVA MÉXICO RV20, S.A. de C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	1285157		19,330.55	.01
CHD	BBVAES	3253038		12,378.06	.00
CHE	BBVAES	1551409		1,423.67	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
EAIM	SANTCME	0000024		108.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				33,240.28	.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	1,411,342.84	.43
CF	FUNO	11	ALTA	1,694,269.32	.52
CF	TERRA	13	ALTA	1,036,179.34	.32
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	BBVACOR	F	AA/4	7,181,314.37	2.19
51	BBVALIQ	F	AAA/1	1,799,179.95	.55
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVACR	F	NA	168,308,845.30	51.37
52	BBVAGF	F	NA	144,631,839.52	44.15
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				326,062,970.64	99.53
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				326,062,970.64	99.53
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
LF	BONDESF	261001	mxAAA	1,516,625.54	.46
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				1,516,625.54	.46
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				327,612,836.46	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

0.712008%

Límite de VaR

2.350%

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.

