

## BBVAC

### FONDO BBVA MÉXICO RV18, S.A. de C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 03 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>DISPONIBILIDADES</b>					
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>					
CHD	BACOMER	1284924		27,161.68	.00
CHD	BBVAES	3251032		480,906.32	.00
CHE	BBVAES	1551447		11,473.10	.00
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>					
AIM	BANDER	0051513		52,253,692.00	.23
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>				52,773,233.10	.23
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					
<b>FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)</b>					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	667,803,822.10	2.93
<b>TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)</b>					
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	770,203,963.50	3.38
1ISP	MBIL	N	ALTA	2,602,758,661.30	11.44
1ISP	VMSTX	N	ALTA	769,964,662.50	3.38
1ISP	XTMXX	N	ALTA	771,830,325.00	3.39
<b>FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA</b>					
51	BBVADCB	F	AAA/2	3,082,907,989.61	13.55
51	BBVALIQ	F	AAA/1	339,396,285.99	1.49
51	BBVAMRF	F	AA/4	709,107,114.48	3.12
<b>FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE</b>					
52	BBVAC+	F	NA	1,872,645,447.04	8.23
52	BBVACR	F	NA	1,785,477,017.38	7.85
52	BBVAGF	F	NA	9,083,776,993.68	39.92
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>				22,455,872,282.58	98.69
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				22,455,872,282.58	98.69
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
IS	BPA182	310327	mxAAA	243,175,191.52	1.07
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>				243,175,191.52	1.07
<b>OPERACIONES CON DERIVADOS</b>					
<b>FUTUROS</b>					
FD	DEUA	DC24		2,537,112.00	.01
<b>TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS</b>				2,537,112.00	.01
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>				22,754,357,819.20	100.00

#### CATEGORÍA

205

VaR Promedio última semana

0.260591%

#### CALIFICACIÓN

N/A

Límite de VaR

1.520%

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 afectan 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.

