

BBVAC

FONDO BBVA MÉXICO RV18, 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	1284924		25,649.35	.00
CHD	BBVAES	3251032		487,029.94	.00
CHE	BBVAES	1551447		9,609.36	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0051513		53,683,698.00	.24
TOTAL DISPONIBILIDADES				54,205,986.65	.24
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	680,003,038.48	2.99
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	770,061,042.00	3.38
1ISP	MBIL	N	ALTA	2,599,973,770.80	11.41
1ISP	VMSTX	N	ALTA	769,103,637.50	3.38
1ISP	XTMXX	N	ALTA	769,947,525.00	3.38
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	BBVADCB	F	AAA/2	3,081,131,981.41	13.53
51	BBVALIQ	F	AAA/1	339,214,401.76	1.49
51	BBVAMRF	F	AA/4	710,591,830.26	3.12
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVAC+	F	NA	1,870,432,338.04	8.21
52	BBVACR	F	NA	1,795,357,304.87	7.88
52	BBVAGF	F	NA	9,091,720,532.42	39.91
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				22,477,537,402.54	98.68
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				22,477,537,402.54	98.68
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
LF	BONDESF	261001	mxAAA	246,172,377.09	1.08
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				246,172,377.09	1.08
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	DC24		637,744.00	.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				637,744.00	.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				22,778,553,510.28	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

0.289610%

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.

