

## BBVAM

### FONDO BBVA MÉXICO RV19, 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	1196723		15,526.85	.00
CHD	BBVAES	3252035		1,442,557.06	.04
CHE	BBVAES	1551416		9,834.94	.00
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>					
AIM	BANDER	0034744		4,025,313.00	.11
EAIM	SANTCME	0000023		343.00	.00
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>				5,493,574.85	.15
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>					
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	14,532,629.02	.40
CF	FUNO	11	ALTA	13,260,019.05	.37
CF	TERRA	13	ALTA	11,714,619.98	.32
<b>FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)</b>					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	49,976,126.00	1.38
<b>TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)</b>					
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	60,779,836.50	1.68
1ISP	MBIL	N	ALTA	211,609,094.55	5.86
1ISP	VMSTX	N	ALTA	60,759,983.70	1.68
1ISP	XTMXX	N	ALTA	60,906,874.00	1.69
<b>FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA</b>					
51	BBVACOR	F	AA/4	93,110,191.50	2.58
51	BBVADCB	F	AAA/2	155,462,196.90	4.30
51	BBVALIQ	F	AAA/1	58,404,268.31	1.62
51	BBVAMRF	F	AA/4	43,239,824.36	1.20
<b>FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE</b>					
52	BBVAC+	F	NA	48,248,097.60	1.33
52	BBVACR	F	NA	882,435,423.84	24.42
52	BBVAGF	F	NA	1,810,262,112.20	50.09
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>				3,574,701,297.51	98.91
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				3,574,701,297.51	98.91
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
IS	BPA182	310327	mxAAA	33,727,397.76	.93
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>				33,727,397.76	.93
<b>OPERACIONES CON DERIVADOS</b>					
<b>FUTUROS</b>					
FD	DEUA	DC24		195,444.00	.01
<b>TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS</b>				195,444.00	.01
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>				3,614,117,714.12	100.00

**CATEGORÍA**

205

**CALIFICACIÓN**

N/A

**VaR Promedio última semana**

0.453630%

**Límite de VaR**

1.700%

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.

