

BBVAM

FONDO BBVA MÉXICO RV19, 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	1196723		13,818.73	.00
CHD	BBVAES	3252035		1,464,863.62	.04
CHE	BBVAES	1551416		7,923.47	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0034744		4,135,472.00	.11
EAIM	SANTCME	0000023		349.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				5,622,426.82	.16
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	14,653,656.68	.41
CF	FUNO	11	ALTA	13,128,278.04	.36
CF	TERRA	13	ALTA	11,714,619.98	.32
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	50,889,073.12	1.41
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
11SP	IB1MXX	N	ALTA	60,768,558.00	1.68
11SP	MBIL	N	ALTA	211,382,677.80	5.85
11SP	VMSTX	N	ALTA	60,692,037.90	1.68
11SP	XTMXX	N	ALTA	60,758,298.00	1.68
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	BBVACOR	F	AA/4	93,536,972.63	2.59
51	BBVADCB	F	AAA/2	155,372,637.91	4.30
51	BBVALIQ	F	AAA/1	58,372,969.16	1.62
51	BBVAMRF	F	AA/4	43,330,359.13	1.20
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVAC+	F	NA	48,191,077.57	1.33
52	BBVACR	F	NA	887,318,553.44	24.57
52	BBVAGF	F	NA	1,811,845,141.73	50.17
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				3,581,954,911.09	99.18
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				3,581,954,911.09	99.18
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
LF	BONDESF	261203	mxAAA	24,097,428.51	.67
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				24,097,428.51	.67
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	DC24		49,128.00	.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				49,128.00	.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				3,611,723,894.42	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

0.513603%

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.

