

BBVAAD

FONDO BBVA MÉXICO RV23, 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	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	1285513		3,455.51	.00
CHD	BBVAES	3119035		20,226.64	.02
CHE	BBVAES	1551379		17,945.22	.02
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
EAIM	SANTCME	0000027		47.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				41,674.37	.04
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	86,463.89	.08
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
11SP	FLOA	N	ALTA	21,427.11	.02
11SP	IBTA	N	ALTA	150,141.07	.14
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVACD+	F	NA	408,263.08	.39
52	BBVACRD	F	NA	46,609,565.08	44.80
52	BBVAGFD	F	NA	56,528,627.66	54.33
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				103,804,487.89	99.77
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				103,804,487.89	99.77
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
IS	BPA182	310327	mxAAA	197,888.25	.19
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				197,888.25	.19
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				104,044,050.51	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio última semana

1.283362%

Límite de VaR

2.810%

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 simultánea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto.

