BBVACD

FONDO BBVA MÉXICO RV21, S.A. de C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE

CARTERA DE VALORES AL 03 SEPTIEMBRE, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	1196758		27,981.82	.00
CHD	BBVAES	3120039		204,257.44	.01
CHE	BBVAES	1551393		14,436.84	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				246,676.10	.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	FLOA	N	ALTA	94,021,802.03	2.86
1ISP	IBTA	N	ALTA	394,923,113.85	12.02
1ISP	IB01	N	ALTA	1,168,181,920.26	35.57
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVACD+	F	NA	587,748,504.51	17.90
52	BBVACRD	F	NA	396,292,304.34	12.07
52	BBVAGFD	F	NA	623,967,500.48	19.00
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				3,265,135,145.47	99.42
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				3,265,135,145.47	99.42
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
LF	BONDESF	271202	mxAAA	18,955,332.63	.58
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				18,955,332.63	.58
TOTAL DE INVERSION EN VALORES				3,284,337,154.20	100.00

CATEGORÍA
205

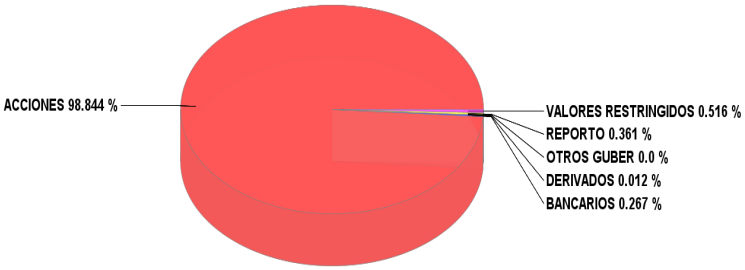
CALIFICACIÓN
BBB

VaR Promedio última semana
1.194493%

Límite de VaR
2.340%

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 implicitos 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.

Creando Oportunidades

Composición de las Carteras de los Fondos Origen