

BBVAMD

FONDO BBVA MÉXICO RV22, 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	1285491		15,136.92	.00
CHD	BBVAES	3118032		18,557.05	.00
CHE	BBVAES	1551362		17,042.44	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
EAIM	SANTCME	0000026		166.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				50,902.41	.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	10,895,368.16	1.93
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
11SP	FLOA	N	ALTA	7,001,263.73	1.24
11SP	IBTA	N	ALTA	26,437,468.43	4.69
11SP	IB01	N	ALTA	68,934,747.36	12.24
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	BBVACD+	F	NA	16,173,574.63	2.87
52	BBVACRD	F	NA	150,134,866.88	26.66
52	BBVAGFD	F	NA	280,449,010.70	49.80
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				560,026,299.89	99.44
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				560,026,299.89	99.44
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
LF	BONDESF	261203	mxAAA	3,080,670.49	.55
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				3,080,670.49	.55
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				563,157,872.79	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

1.198932%

Límite de VaR

2.520%

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

