

BBVAMA2

FONDO BBVA MÉXICO RV13, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE

CARTERA DE VALORES AL 29 MAYO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	8568642		24,276.14	.00
CHE	BBVAES	1550185		16,141.53	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				40,417.67	.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	BBEU	*	ALTA	83,707,145.30	2.45
1ISP	BBIL	N	ALTA	136,678,819.78	4.00
1ISP	BBUS	*	ALTA	441,527,376.90	12.91
1ISP	CJPU	N	ALTA	107,647,962.27	3.15
1ISP	CNYA	N	ALTA	2,384,800.68	.07
1ISP	EEM	*	ALTA	78,173,589.06	2.29
1ISP	EPP	*	ALTA	18,461,480.11	.54
1ISP	EWC	*	ALTA	25,255,655.55	.74
1ISP	HYG	*	ALTA	130,770,547.09	3.82
1ISP	JPEA	N	ALTA	252,503.55	.01
1ISP	LQDA	N	ALTA	860,655,832.07	25.17
1ISP	MTXX1	N	ALTA	495,364,349.12	14.49
1ISP	TLT	*	ALTA	278,825,833.83	8.15
1ISP	XLC	*	ALTA	32,235,637.96	.94
1ISP	XLE	*	ALTA	26,073,870.88	.76
1ISP	XLK	*	ALTA	43,649,567.18	1.28
1ISP	XUSTX	N	ALTA	652,121,787.79	19.07
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				3,413,786,759.12	99.84
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				3,413,786,759.12	99.84
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IS	BPA182	300328	mxAAA	5,392,362.52	.16
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				5,392,362.52	.16
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				3,419,219,539.31	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

1.314340%

Límite de VaR

1.730%

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.