

BBVAMA2

FONDO BBVA MÉXICO RV13, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 31 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	8568642		20,687.10	.00
CHE	BBVAES	1550185		15,001.36	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				35,688.46	.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	BBEU	*	ALTA	134,342,974.04	3.02
1ISP	BBIL	N	ALTA	88,233,008.51	1.98
1ISP	CJPU	N	ALTA	134,976,602.54	3.03
1ISP	CNYA	N	ALTA	2,042,798.40	.05
1ISP	CSPX	N	ALTA	923,991,697.62	20.75
1ISP	EPP	*	ALTA	32,952,402.15	.74
1ISP	EWC	*	ALTA	31,555,840.03	.71
1ISP	HYG	*	ALTA	313,287,294.31	7.04
1ISP	JPEA	N	ALTA	264,128.18	.01
1ISP	LQDA	N	ALTA	1,106,324,839.34	24.85
1ISP	MTXX1	N	ALTA	860,258,173.12	19.32
1ISP	TLT	*	ALTA	218,353,803.49	4.90
1ISP	XUSTX	N	ALTA	597,169,294.03	13.41
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				4,443,752,855.76	99.80
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				4,443,752,855.76	99.80
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IS	BPA182	300328	mxAAA	8,721,867.48	.20
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				8,721,867.48	.20
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				4,452,510,411.70	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

1.415347%

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.