

## BBVAMA3

### FONDO BBVA MÉXICO RV14, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 04 JUNIO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>DISPONIBILIDADES</b>					
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>					
CHD	BACOMER	1186272		24,214.92	.00
CHD	BBVAES	3104039		6,915.24	.00
CHE	BBVAES	1550161		16,012.46	.00
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>					
EAIM	SANTCME	0000015		1.00	.00
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>				47,143.62	.01
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					
<b>TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)</b>					
1ISP	BBEU	*	ALTA	42,248,839.44	5.56
1ISP	BBIL	N	ALTA	26,413,747.28	3.47
1ISP	BBUS	*	ALTA	215,352,612.86	28.32
1ISP	CJPU	N	ALTA	30,126,125.50	3.96
1ISP	EEM	*	ALTA	16,381,655.53	2.15
1ISP	EPP	*	ALTA	7,697,542.78	1.01
1ISP	EWC	*	ALTA	9,920,239.22	1.30
1ISP	HYG	*	ALTA	29,526,052.44	3.88
1ISP	LQDA	N	ALTA	126,755,037.01	16.67
1ISP	MTXX1	N	ALTA	89,454,662.66	11.76
1ISP	TLT	*	ALTA	62,538,310.06	8.22
1ISP	XLC	*	ALTA	6,216,397.77	.82
1ISP	XLE	*	ALTA	6,627,285.08	.87
1ISP	XLK	*	ALTA	8,582,623.65	1.13
1ISP	XUSTX	N	ALTA	75,091,197.64	9.88
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>				752,932,328.92	99.02
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				752,932,328.92	99.02
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
IQ	BPAG91	280511	mxAAA	7,383,753.25	.97
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>				7,383,753.25	.97
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>				760,363,225.79	100.00

#### CATEGORÍA

205

#### CALIFICACIÓN

N/A

#### VaR Promedio última semana

1.261168%

#### Límite de VaR

1.930%



Creando Oportunidades

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.