

BBVAMA3

FONDO BBVA MÉXICO RV14, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE

CARTERA DE VALORES AL 30 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	1186272		20,437.51	.00
CHD	BBVAES	3104039		6,128.19	.00
CHE	BBVAES	1550161		14,859.28	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
EAIM	SANTCME	0000015		1.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				41,425.98	.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	BBEU	*	ALTA	61,795,563.66	6.24
1ISP	BBIL	N	ALTA	16,038,864.84	1.62
1ISP	CJPU	N	ALTA	42,194,438.66	4.26
1ISP	CSPX	N	ALTA	354,402,899.21	35.79
1ISP	EPP	*	ALTA	9,630,735.75	.97
1ISP	EWC	*	ALTA	14,279,115.35	1.44
1ISP	HYG	*	ALTA	69,216,470.42	6.99
1ISP	JPEA	N	ALTA	106,838.37	.01
1ISP	LQDA	N	ALTA	165,379,046.98	16.70
1ISP	MTXX1	N	ALTA	160,482,569.84	16.21
1ISP	TLT	*	ALTA	49,356,183.65	4.98
1ISP	XUSTX	N	ALTA	45,791,592.41	4.62
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				988,674,319.14	99.83
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				988,674,319.14	99.83
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
IQ	BPAG91	280106	mxAAA	1,604,313.66	.16
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				1,604,313.66	.16
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				990,320,058.78	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio última semana

1.457851%

Límite de VaR

1.930%

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.