

BBVAMA3

FONDO BBVA MÉXICO RV14, 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	1186272		24,287.59	.00
CHD	BBVAES	3104039		6,936.04	.00
CHE	BBVAES	1550161		16,141.53	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
EAIM	SANTCME	0000015		1.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				47,366.16	.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	BBEU	*	ALTA	42,365,044.99	5.52
1ISP	BBIL	N	ALTA	26,476,635.19	3.45
1ISP	BBUS	*	ALTA	215,573,701.50	28.08
1ISP	CJPU	N	ALTA	29,992,757.58	3.91
1ISP	EEM	*	ALTA	16,312,036.68	2.12
1ISP	EPP	*	ALTA	7,781,046.66	1.01
1ISP	EWC	*	ALTA	9,847,931.26	1.28
1ISP	HYG	*	ALTA	29,792,929.92	3.88
1ISP	LQDA	N	ALTA	127,437,473.33	16.60
1ISP	MTXX1	N	ALTA	90,757,055.55	11.82
1ISP	TLT	*	ALTA	62,917,162.87	8.19
1ISP	XLC	*	ALTA	6,377,316.14	.83
1ISP	XLE	*	ALTA	6,368,884.34	.83
1ISP	XLK	*	ALTA	8,512,626.17	1.11
1ISP	XUSTX	N	ALTA	75,371,717.12	9.82
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				755,884,319.30	98.45
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				755,884,319.30	98.45
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IS	BPA182	300328	mxAAA	11,884,388.66	1.55
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				11,884,388.66	1.55
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				767,816,074.12	100.00

CATEGORÍA
205

CALIFICACIÓN
N/A

VaR Promedio Mes
1.254137%

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.