

## BBVAGL3

### FONDO BBVA MÉXICO RV15, 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	%
<b>DISPONIBILIDADES</b>					
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>					
CHD	BACOMER	1284649		26,559.98	.01
CHE	BBVAES	1550192		18,679.75	.00
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>					
AIM	BANDER	0056600		2,374,004.00	.47
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>				2,419,243.73	.48
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					
<b>TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)</b>					
1ISP	CSPXX	N	ALTA	56,068,662.00	11.14
1ISP	EIMI	N	ALTA	13,366,258.94	2.66
1ISP	EMCA	N	ALTA	8,220,472.24	1.63
1ISP	IBTMXX	N	ALTA	55,200,156.00	10.97
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	4,964,058.00	.99
1ISP	IDTXX	N	ALTA	47,829,523.50	9.50
1ISP	IHYMXX	N	ALTA	26,199,710.35	5.21
1ISP	JPAX	N	ALTA	8,128,823.00	1.62
1ISP	IMEAX	N	ALTA	18,023,720.00	3.58
1ISP	JPEA	N	ALTA	16,377,979.71	3.25
1ISP	LEMB	*	ALTA	7,013,161.92	1.39
1ISP	LQDMX	N	ALTA	126,793,894.50	25.19
1ISP	VUAA	N	ALTA	35,067,954.46	6.97
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>				423,254,374.62	84.10
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
M	BONOS	290301	mxAAA	67,470,791.01	13.41
M	BONOS	421113	mxAAA	6,582,517.00	1.31
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>				74,053,308.01	14.71
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				497,307,682.63	98.81
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
IQ	BPAG91	280106	mxAAA	3,388,901.94	.67
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>				3,388,901.94	.67
<b>OPERACIONES CON DERIVADOS</b>					
<b>FUTUROS</b>					
FD	DEUA	MR25		162,792.00	.03
FD	DEUA	MR25		22,032.00	.00
<b>TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS</b>				184,824.00	.04
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>				503,300,652.30	100.00

**CATEGORÍA**

205

**CALIFICACIÓN**

N/A

**VaR Promedio última semana**

0.659310%

**Límite de VaR**

1.530%

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.