

BBVAGL3

FONDO BBVA MÉXICO RV15, 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	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	1284649		32,854.65	.00
CHE	BBVAES	1550192		17,605.68	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0056600		16,953,919.00	1.31
TOTAL DISPONIBILIDADES				17,004,379.33	1.31
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	AGG	*	ALTA	129,229,819.21	9.96
1ISP	CNDX	N	ALTA	57,945,575.89	4.46
1ISP	CSPXX	N	ALTA	135,285,298.20	10.42
1ISP	DTMXX	N	ALTA	24,605,432.50	1.90
1ISP	EMCA	N	ALTA	17,508,578.97	1.35
1ISP	EUFN	*	ALTA	23,156,795.88	1.78
1ISP	EWT	*	ALTA	14,702,517.70	1.13
1ISP	EWY	*	ALTA	10,420,079.85	.80
1ISP	EWZ	*	ALTA	14,094,607.25	1.09
1ISP	IBTMXX	N	ALTA	106,333,892.00	8.19
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	68,460,980.50	5.27
1ISP	IDTP	N	ALTA	33,115,182.67	2.55
1ISP	IHF	*	ALTA	17,557,078.98	1.35
1ISP	IHYMXX	N	ALTA	23,351,535.90	1.80
1ISP	JPAX	N	ALTA	19,629,105.25	1.51
1ISP	IMEAX	N	ALTA	21,669,574.10	1.67
1ISP	IWM	*	ALTA	11,560,602.61	.89
1ISP	JPEA	N	ALTA	58,137,870.90	4.48
1ISP	KRE	*	ALTA	23,269,701.69	1.79
1ISP	LEMB	*	ALTA	18,328,745.08	1.41
1ISP	LQDMX	N	ALTA	183,112,104.00	14.11
1ISP	MCHI	*	ALTA	9,286,846.97	.72
1ISP	RSP	*	ALTA	23,316,106.24	1.80
1ISP	VUAA	N	ALTA	14,693,042.78	1.13
1ISP	XLI	*	ALTA	27,132,107.34	2.09
1ISP	XOP	*	ALTA	5,398,771.43	.42
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				1,091,301,953.89	84.08
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	290301	mxAAA	167,618,868.38	12.91
M	BONOS	421113	mxAAA	3,906,621.42	.30
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				171,525,489.80	13.21
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				1,262,827,443.69	97.29
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
IQ	BPAG91	280511	mxAAA	17,334,969.91	1.34
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				17,334,969.91	1.34
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	JN26		76,373.00	.01

FD	DEUA	JN26	28,567.00	.00
FD	DEUA	JN26	36,146.00	.00
FD	DEUA	JN26	192,973.00	.01
FD	DEUA	JN26	27,984.00	.00
FD	DEUA	JN26	142,252.00	.01
FD	DEUA	JN26	35,563.00	.00
FD	DEUA	JN26	226,204.00	.02
FD	DEUA	JN26	34,980.00	.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS			801,042.00	.06
TOTAL DE INVERSION EN VALORES			1,297,967,834.93	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio última semana

0.586933%

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 simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto.