

BBVAGL5

FONDO BBVA MÉXICO RV16, 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	1284738		24,207.66	.01
CHE	BBVAES	1550178		14,004.88	.01
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0090728		12,339.00	.01
EAIM	SANTCME	0000016		16.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				50,567.54	.02
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	AGG	*	ALTA	9,815,980.91	4.20
1ISP	CNDX	N	ALTA	9,290,597.28	3.98
1ISP	CSPXX	N	ALTA	73,324,328.70	31.40
1ISP	DTMXX	N	ALTA	695,117.50	.30
1ISP	EIMI	N	ALTA	10,091,007.27	4.32
1ISP	EUFN	*	ALTA	5,499,180.03	2.35
1ISP	EWT	*	ALTA	4,747,878.45	2.03
1ISP	EWY	*	ALTA	2,997,315.69	1.28
1ISP	EWZ	*	ALTA	2,976,937.86	1.27
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	4,343,333.50	1.86
1ISP	IDTP	N	ALTA	787,604.34	.34
1ISP	IHF	*	ALTA	4,314,142.32	1.85
1ISP	JPAX	N	ALTA	11,420,489.50	4.89
1ISP	IMEAX	N	ALTA	20,623,988.60	8.83
1ISP	IWM	*	ALTA	1,746,711.14	.75
1ISP	JPEA	N	ALTA	5,272,046.72	2.26
1ISP	KRE	*	ALTA	5,596,633.05	2.40
1ISP	MCHI	*	ALTA	2,895,214.77	1.24
1ISP	RSP	*	ALTA	6,360,263.46	2.72
1ISP	VUAA	N	ALTA	26,772,249.31	11.46
1ISP	XLI	*	ALTA	4,272,796.79	1.83
1ISP	XOP	*	ALTA	617,931.67	.26
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				214,461,748.86	91.84
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	290301	mxAAA	5,657,279.02	2.42
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				5,657,279.02	2.42
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				220,119,027.88	94.26
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IQ	BPAG91	280511	mxAAA	13,350,310.62	5.72
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				13,350,310.62	5.72
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	JN26		583.00	.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS				583.00	.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				233,520,489.04	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio última semana

1.309418%

Límite de VaR

2.930%

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