

BBVAGL5

FONDO BBVA MÉXICO RV16, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 31 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	1284738		16,551.34	.01
CHE	BBVAES	1550178		15,001.36	.01
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0090728		1,133,163.00	.98
EAIM	SANTCME	0000016		19.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				1,164,734.70	1.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	CSPXX	N	ALTA	38,280,879.00	33.12
1ISP	EIMI	N	ALTA	10,527,076.02	9.11
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	1,146,005.00	.99
1ISP	IDTXX	N	ALTA	1,056,524.00	.91
1ISP	IHYMXX	N	ALTA	916,770.40	.79
1ISP	IJPAX	N	ALTA	6,353,974.40	5.50
1ISP	IMEAX	N	ALTA	13,761,755.00	11.91
1ISP	JPEA	N	ALTA	660,919.64	.57
1ISP	LEMB	*	ALTA	627,432.30	.54
1ISP	LQDMX	N	ALTA	2,585,621.00	2.24
1ISP	VUAA	N	ALTA	36,921,957.92	31.95
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				112,838,914.68	97.64
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	290301	mxAAA	1,445,211.03	1.25
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				1,445,211.03	1.25
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				114,284,125.71	98.89
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IS	BPA182	300328	mxAAA	300,693.61	.26
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				300,693.61	.26
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	MR25		-148,132.00	-.13
FD	DEUA	MR25		-35,756.00	-.03
FD	DEUA	MR25		-657.00	-.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					
				-184,545.00	
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

1.224823%

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