

BBVAC+

FONDO BBVA MÉXICO RV17, S.A. de C.V. FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	3035921		8,861.45	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES				8,861.45	.00
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	CSPXX	N	ALTA	327,236,097.50	.18
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	47,857,530,672.00	27.01
1ISP	MBIL	N	ALTA	43,088,042,386.20	24.32
1ISP	VMSTX	N	ALTA	39,298,592,969.25	22.18
1ISP	XTMXX	N	ALTA	46,050,451,875.00	25.99
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				176,621,853,999.95	99.69
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				176,621,853,999.95	99.69
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
LF	BONDEF	261001	mxAAA	422,133,505.21	.24
LF	BONDEF	261203	mxAAA	125,275,286.17	.07
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				547,408,791.38	.31
TOTAL DE INVERSION EN VALORES				177,169,271,652.78	100.00

CATEGORÍA

205

CALIFICACIÓN

N/A

VaR Promedio Mes

0.003033%

Límite de VaR

0.300%

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.