BBVA

Creando Oportunidades

BBVACD+

FONDO BBVA MÉXICO RV26, S.A. de C.V. FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE

CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	3135411		8,345,833.10	.06
TOTAL DISPONIBILIDADES				8,345,833.10	.06
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
TRACS (Títulos Referenciados a Acciones) Extranjeros (SPOT)					
1ISP	BBIL	N	ALTA	3,683,797,617.81	28.44
1ISP	CSPX	N	ALTA	25,390,488.09	.20
1ISP	IB01	N	ALTA	3,879,938,166.31	29.96
1ISP	VDST	N	ALTA	3,208,546,055.13	24.77
1ISP	XT0D	N	ALTA	2,100,318,503.79	16.22
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				12,897,990,831.13	99.58
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				12,897,990,831.13	99.58
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
LF	BONDESF	271014	mxAAA	46,021,875.11	.36
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				46,021,875.11	.36
TOTAL DE INVERSION EN VALORES				12,952,358,539.34	100.00

CATEGORÍA
205

CALIFICACIÓN
N/A

VaR Promedio Mes
1.287954%

Límite de VaR
2.260%

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 implicitos 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.