

GOLD2+					
BLK Portafolio Estratégico Gold Moderado, S.A. de C.V. F I R V					
DISCRECIONAL					
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
1	Acciones Ind.,Com. y de Serv.			106,997,269	1.0748%
1	GFNORTE	O	Alta	17,289,272	0.1737%
1	WALMEX	*	Alta	15,103,278	0.1517%
1	CEMEX	CPO	Alta	12,168,427	0.1222%
1	FEMSA	UBD	Alta	11,981,239	0.1204%
1	GMEXICO	B	Alta	8,700,942	0.0874%
1	ALSEA	*	Alta	8,696,546	0.0874%
1	GENTERA	*	Alta	8,633,867	0.0867%
1	ALFA	A	Alta	6,252,994	0.0628%
1	VESTA	*	Alta	6,081,156	0.0611%
1	AMX	B	Alta	6,057,520	0.0609%
1	GCC	*	Alta	6,032,030	0.0606%
	Aportaciones iniciales mínimas			3,861,729	0.0388%
AIM	701925	3583199		3,861,729	0.0388%
	CPOs sobre Acciones del IPC			65,049,713	0.6535%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	65,049,713	0.6535%
	Cert. Burs. Fiduc. Inmob.			11,714,188	0.1177%
CF	FIBRAPL	14	Alta	5,904,775	0.0593%
CF	DANHOS	13	Media	5,809,413	0.0584%
	Chequera dolares			61,019,398	0.6130%
CHD	40-002	6499006		61,019,398	0.6130%
	Excedentes de AIMS			1	
EAIM	701925	3583199		1	
	Fondos de Inversión de Renta Variable			586,833,207	5.8950%
52	BLKINT1	MO-A		491,450,229	4.9368%
52	BLKEM1	MO-A		36,182,704	0.3635%
52	BLKFUSA	MO-A		25,862,432	0.2598%
52	BLKPAT	MO-A		23,837,701	0.2395%
52	BLKMED	MO-A		9,500,141	0.0954%
	Fondos de Inversión de Deuda			528,925,706	5.3133%
51	BLKGUB1	MO-F	AAA/2(mex)	528,925,706	5.3133%
	TRAC Tít. ref. acciones extr.			8,594,995,786	86.3401%
1I	IB1MX	N		6,811,942,560	68.4286%
1I	I37MX	N		1,269,830,881	12.7559%
1I	SDMX	N		276,840,596	2.7810%
1ISP	COMT	*		74,886,323	0.7523%
1ISP	IUIT	N		29,193,891	0.2933%
1ISP	EZU	*		19,540,137	0.1963%
1ISP	EDMJ	N		17,585,116	0.1767%
1ISP	IUHC	N		13,414,708	0.1348%
1ISP	IUIS	N		11,894,126	0.1195%
1ISP	IUCD	N		11,094,421	0.1115%
1ISP	ESGE	*		10,453,991	0.1050%
1ISP	IUCM	N		9,966,347	0.1001%
1ISP	IUFS	N		9,046,183	0.0909%
1ISP	SAWD	N		7,030,025	0.0706%
1ISP	CCAU	N		6,541,411	0.0657%
1ISP	OMXS	N		4,296,049	0.0432%
1ISP	IUCS	N		4,134,956	0.0415%
1ISP	IUES	N		3,476,367	0.0349%
1ISP	IUNS	N		1,934,453	0.0194%
1ISP	CSUK	N		1,293,071	0.0130%
1ISP	IAUS	N		510,714	0.0051%
1ISP	MTUM	*		19,444	0.0002%
1ISP	HDV	*		11,666	0.0001%
1ISP	UR	*		11,477	0.0001%
1ISP	VLUE	*		10,642	0.0001%
1ISP	EWL	*		5,206	0.0001%
1ISP	IYE	*		4,733	0.0001%
1ISP	XLRE	*		4,290	0.0000%
1I	IHYMX	N		4,221	0.0000%
1ISP	EWI	*		3,827	0.0000%
1I	EMBMXX	N		3,814	0.0000%
1ISP	EWG	*		3,215	0.0000%
1ISP	EWS	*		2,032	0.0000%
1ISP	EWI	*		1,594	0.0000%
1ISP	SUAS	N		1,522	0.0000%
1ISP	EDMW	N		892	0.0000%
1ISP	IUUS	N		886	0.0000%
	Ops con Instrumentos Financieros Derivados			(4,580,349)	
FWDS	USDMXN	240918		(905,242)	
FWDS	USDMXN	240918		(2,762,810)	
FWDS	USDMXN	240918		(1,814,389)	
FWDS	USDMXN	240918		(1,098,546)	
FWDS	USDMXN	240918		(324,653)	
FWDS	USDMXN	240918		1,009,798	0.0101%
FWDS	USDMXN	240918		471,477	0.0047%
FCSP	ES	U4		452,177	0.0045%
FCSP	ES	U4		251,209	0.0025%
FWDS	USDMXN	240918		140,629	0.0014%
	TOTAL CARTERA			9,954,816,648	100.0000%
	ACTIVO NETO			9,943,181,478	
	Límite máximo Valor Riesgo				0.9000%
	Promedio				0.1469%
	Cartera al:	30-Aug-24			
SUPUESTOS: Nivel de Confianza: 95%, Observaciones: 500, Ventana de Tiempo: 1 días					
METODOLOGÍA PARA CÁLCULO: VaR Histórico					
FECHA DE CÁLCULO DE VaR PROMEDIO: del 01-Ago-2024 al 30-Ago-2024					
Con fundamento en el artículo 136 de las Disposiciones de Carácter General aplicables a los Fondos de Inversión y las personas que les prestan servicios, a continuación se presentan las direcciones electrónicas donde pueden consultar la tenencia indirecta de los Activos Objeto de Inversión en acciones de otros fondos de inversión y/o mecanismos de inversión colectiva que representan en el individuo más del 10% del valor de la cartera de cada uno de los fondos de inversión administrados por BlackRock México Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión: https://www.blackrock.com , https://www.blackrock.com/mx , https://www.blackrock.com/ur , https://www.blackrock.com/uk , https://www.ssga.com/us , https://www.blackrock.com/lu					
Los riesgos asociados por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios, valores estructurados o respaldados por activos, consiste en que estos instrumentos están sujetos a diversos factores como las fluctuaciones en los mercados de valores, cambios en las tasas de interés locales y a nivel internacional, tipos de cambio, inflación, así como las variaciones en el riesgo país del emisor, lo cual incrementa la volatilidad del rendimiento de estos valores. Adicionalmente, el valor de estos activos podría verse afectado por falta oportuna de pago de capital y/o intereses y esta a su vez podría generar posibles minusvalías al patrimonio o rendimiento de los inversionistas. Por lo anterior, la inversión en este tipo de activos tiene un riesgo asociado alto. Para mayor detalle consultar el prospecto de inversión del Fondo.					