

Latin 9, SA de CV, Fondo de Inversión de Renta Variable

Cartera de Valores al 31/agosto/2017

AXESEDM Especializado en acciones internacionales

Tenencia	Emisora	Calificación o Bursatilidad	Instrum Tenencia	Divisa	Titulos	Valor Razonable	%		
D	1ASP_0JN9_N	Alta	Acciones SIC	DKK	56,200	63,391,004	2.8%		
D	1ASP_0QBO_N	Alta	Acciones SIC	DKK	10,600	16,116,310	0.7%		
D	1ASP_0R87_N	Alta	Acciones SIC	SEK	42,200	16,076,400	0.7%		
D	1ASP_AGK_N	Alta	Acciones SIC	GBP	181,700	36,794,086	1.6%		
D	1ASP_AI_N	Alta	Acciones SIC	EUR	38,900	85,985,768	3.8%		
D	1ASP_ASC_N	Alta	Acciones SIC	GBP	16,000	21,496,165	1.0%		
D	1ASP_BABB_N	Alta	Acciones SIC	GBP	109,600	21,572,117	1.0%		
D	1ASP_BME_N	Alta	Acciones SIC	EUR	96,077	61,524,128	2.7%		
D	1ASP_BNR_N	Alta	Acciones SIC	EUR	60,800	60,253,403	2.7%		
D	1ASP_BRSN_N	Alta	Acciones SIC	GBP	73,800	22,027,873	1.0%		
D	1ASP_CFR1_N	Alta	Acciones SIC	CHF	35,500	52,593,664	2.3%		
D	1ASP_CIEA_N	Alta	Acciones SIC	EUR	54,800	23,494,771	1.0%		
D	1ASP_DEO_N	Alta	Acciones SIC	USD	23,400	52,764,597	2.4%		
D	1ASP_DSY_N	Alta	Acciones SIC	EUR	59,574	102,351,190	4.6%		
D	1ASP_DUFN_N	Alta	Acciones SIC	CHF	29,000	82,036,411	3.7%		
D	1ASP_EI_N	Alta	Acciones SIC	EUR	25,900	62,396,247	2.8%		
D	1ASP_ELIS_N	Alta	Acciones SIC	EUR	173,800	74,910,122	3.3%		
D	1ASP_ESNT_N	Alta	Acciones SIC	GBP	648,700	80,438,998	3.6%		
D	1ASP_GEST_N	Alta	Acciones SIC	EUR	117,600	14,920,161	0.7%		
D	1ASP_GRFP_N	Alta	Acciones SIC	EUR	473,207	170,659,185	7.6%		
D	1ASP_HMB_N	Alta	Acciones SIC	SEK	84,360	39,029,055	1.7%		
D	1ASP_ITX_N	Alta	Acciones SIC	EUR	199,000	138,985,095	6.2%		
D	1ASP_LISP_N	Alta	Acciones SIC	CHF	280	27,663,462	1.2%		
D	1ASP_MBWS_N	Alta	Acciones SIC	EUR	83,542	25,763,025	1.2%		
D	1ASP_MC_N	Alta	Acciones SIC	EUR	9,400	42,032,754	1.9%		
D	1ASP_ML_N	Alta	Acciones SIC	EUR	9,300	22,231,597	1.0%		
D	1ASP_NVO_N	Alta	Acciones SIC	USD	165,700	121,843,729.00	5.4%		
D	1ASP_NZYM_N	Alta	Acciones SIC	DKK	25,300	20,914,393.00	0.9%		
D	1ASP_RB_N	Alta	Acciones SIC	GBP	44,800	77,347,662.00	3.5%		
D	1ASP_ROG_N	Alta	Acciones SIC	CHF	31,600	141,086,231.00	6.3%		
D	1ASP_SY1_N	Alta	Acciones SIC	EUR	16,900	20,895,735.00	0.9%		
D	1ASP_UL_N	Alta	Acciones SIC	USD	65,200	65,958,200.00	2.9%		
D	1ESP_ANB_*	Alta	Acciones SIC	MXP	10,500	22,670,235.00	1.0%		
D	1ISP_IBGS_N	Alta	ETF SIC	GBP	78,320	233,742,849.00	10.4%		
R	LD_BONDESD_171221	AAA (mex)	Reporto	MXP	7.07%	7.10%	1,161,409	116,554,423.00	5.2%
						0.37%	2,238,521,045	100.0%	

Activo Neto:	2,458,225,234	
VaR Autorizado (1 día) ⁽¹⁾	82,350,545	3.350%
Var Observado Promedio:	40,229,390	1.637%

"El presente estado de valuación de cartera de inversión, se formuló de conformidad con los criterios de contabilidad aplicables a la sociedad, emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de valores con fundamento en el artículo 76 de la ley de Sociedades de Inversión, de observancia general y obligatoria, aplicadas de manera consistente, encontrándose reflejadas las operaciones con activos objetos de inversión efectuadas por la sociedad durante el periodo arriba mencionado, las cuales se realizaron y valoraron con apego a sanas prácticas y a las disposiciones legales y administrativas aplicables.

El presente estado de valuación de cartera de inversión fue aprobado por el consejo de administración bajo la responsabilidad de los directivos que los suscriben"

MIGUEL ALVAREZ DEL RIO
POR LA OPERADORA ADMINISTRADORA

CARLOS H. RODRIGUEZ GIACINTI
DIRECTOR DE LAS SOCIEDADES

(1) Metodología para el cálculo del VaR: Simulación histórica (dos colas) con 500 escenarios y un nivel de confianza del 95%