finaccess
fondos de inversión

Latin 5 SA de CV, Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

Cartera de Valores al 13/diciembre/2018

AXESCP Especializada Gubernamental Corto Plazo AAAf/S2 (mex)

Tenencia	Emisora	Calificación o Bursatilidad	Instrum Tenencia	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	%
D	BI_CETES_190314	mxAAA	Cete	MXP	8.31%	8.31%	4,907,200	48,073,507	1.6%
D	IM_BPAG28_190221	AAA (mex)	Bonos IPAB 28	MXP	8.25%	8.25%	1,500,000	150,469,930.50	5.0%
D	IM_BPAG28_190725	AAA (mex)	Bonos IPAB 28	MXP	8.26%	8.26%	3,000,000	299,914,365.00	9.9%
D	IM_BPAG28_191121	AAA (mex)	Bonos IPAB 28	MXP	8.27%	8.27%	2,000,000	200,787,850.00	6.7%
D	IM_BPAG28_200220	AAA (mex)	Bonos IPAB 28	MXP	8.29%	8.29%	1,500,000	150,290,094.00	5.0%
D	IM_BPAG28_210513	AAA (mex)	Bonos IPAB 28	MXP	8.32%	8.32%	1,000,000	99,996,335.00	3.3%
D	IQ_BPAG91_190417	AAA (mex)	Bonos IPAB 91	MXP	8.36%	8.36%	1,250,000	126,467,255.00	4.2%
D	IQ_BPAG91_190822	AAA (mex)	Bonos IPAB 91	MXP	8.38%	8.38%	1,000,000	100,429,008.00	3.3%
D	IQ_BPAG91_200423	AAA (mex)	Bonos IPAB 91	MXP	8.38%	8.38%	500,000	50,472,429.50	1.7%
D	IQ_BPAG91_201224	AAA (mex)	Bonos IPAB 91	MXP	8.39%	8.39%	1,000,000	101,512,628.00	3.4%
D	LD_BONDESD_190411	AAA (mex)	Bonde LD	MXP	8.25%	8.25%	1,500,000	150,704,790.00	5.0%
D	LD_BONDESD_190627	AAA (mex)	Bonde LD	MXP	8.26%	8.26%	1,000,000	99,979,335.00	3.3%
D	LD_BONDESD_190808	AAA (mex)	Bonde LD	MXP	8.26%	8.26%	2,500,000	250,715,912.50	8.3%
D	LD_BONDESD_191003	AAA (mex)	Bonde LD	MXP	8.26%	8.26%	1,000,000	100,274,397.00	3.3%
D	LD_BONDESD_191205	AAA (mex)	Bonde LD	MXP	8.27%	8.27%	1,765,000	176,663,366.64	5.9%
D	LD_BONDESD_191226	AAA (mex)	Bonde LD	MXP	8.27%	8.27%	2,000,000	200,491,332.00	6.6%
D	LD_BONDESD_201126	AAA (mex)	Bonde LD	MXP	8.30%	8.30%	1,000,000	100,117,042.00	3.3%
D	LD_BONDESD_210325	AAA (mex)	Bonde LD	MXP	8.32%	8.32%	1,750,000	174,784,604.75	5.8%
R	LD_BONDESD_220113	AAA (mex)	Reporto	MXP	8.04%	8.32%	4,341,055	434,540,556.19	14.4%
Total						8.29%	3,016,684,739		100.0%

Activo Neto:	**3,015,870,238**	
VaR Autorizado (1 día) (1)	**452,381**	**0.015%**
Var Observado Promedio:	**133,800**	**0.004%**

Riesgo Crediticio	**AAAf Sobresaliente**	Calidad y diversificación de los activos del portafolio, fuerzas y debilidades de la administración y capacidad operativa.
Riesgo de Mercado	**s2 - Moderada**	Sensibilidad ante las condiciones cambiantes en los factores de mercado.

"El fondo no se encuentra en una estrategia temporal de inversión.

CARLOS H. RODRIGUEZ GIACINTI
DIRECTOR DE LAS SOCIEDADES

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