

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

Cartera de Valores al 17/septiembre/2020

AXESCP										Especializado Gubernamental Corto Plazo		AAAf/S2 (mex)	
Tenencia	Emisora/Serie	Descripción	Calificación o Bursatilidad	Tipo Instrumento	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	% Cartera			
D	BI_CETES_201008	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	4.41%	4.41%	20,000,000	199,511,380	8.8%			
D	IM_BPAG28_210513	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.60%	4.60%	1,000,000	100,151,077.00	4.4%			
D	IM_BPAG28_210812	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.60%	4.60%	1,000,000	100,041,542.00	4.4%			
D	IM_BPAG28_220512	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.64%	4.64%	1,000,000	100,026,313.00	4.4%			
D	IM_BPAG28_230209	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.68%	4.68%	1,000,000	99,965,423.00	4.4%			
D	IQ_BPAG91_201224	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 91	MPS	4.50%	4.50%	1,000,000	101,344,890.00	4.5%			
D	IS_BPA182_220908	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.48%	4.48%	500,000	49,994,607.00	2.2%			
D	LD_BONDESD_201126	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.60%	4.59%	1,750,000	175,316,536.50	7.7%			
D	LD_BONDESD_210325	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.61%	4.60%	1,750,000	175,130,035.50	7.7%			
D	LD_BONDESD_210527	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.62%	4.61%	2,000,000	199,940,056.00	8.8%			
D	LD_BONDESD_210819	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.63%	4.62%	500,000	49,974,159.50	2.2%			
D	LD_BONDESD_220113	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.64%	4.63%	2,000,000	200,337,884.00	8.8%			
D	LD_BONDESD_220428	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.65%	4.64%	1,500,000	149,800,710.00	6.6%			
D	LD_BONDESD_230831	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.70%	4.70%	500,000	49,891,479.00	2.2%			
D	LD_BONDESD_240627	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.72%	4.71%	700,000	69,807,766.00	3.1%			
<b>Total</b>	<b>R</b>	<b>BI CETES 201022</b>	<b>SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO</b>	<b>mxAAA</b>	<b>Reporto</b>	<b>4.47%</b>	<b>4.39%</b>	<b>45,078,887</b>	<b>448,917,510.16</b>	<b>19.8%</b>			
									<b>4.55%</b>	<b>2,270,151,369</b>	<b>100.0%</b>		

<b>Activo Neto:</b>	<b>2,268,299,258</b>	
<b>VaR Autorizado (1 día) <sup>(1)</sup></b>	<b>340,245</b>	<b>0.015%</b>
<b>Var Observado Promedio:</b>	<b>75,630</b>	<b>0.003%</b>

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

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

MIGUEL ÁLVAREZ DEL RÍO  
DIRECTOR GENERAL

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