

Latin 2 SA de CV, Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

Cartera de Valores al 17/septiembre/2020

AXESLP

Largo Plazo

AAAf/S5 (mex)

Tenencia	Emisora/Serie	Descripción	Calificación o Bursatilidad	Tipo Instrumento	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	% Cartera
D	91_ACBE_17	AC BEBIDAS S. DE R.L. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	6.46%	6.46%	150,000	16,180,979	1.1%
D	91_BBVALMX_18-2	BBVA LEASING SA DE CV	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	5.93%	5.93%	300,000	33,286,199.10	2.3%
D	91_BIMBO_16	GRUPO BIMBO S.A.B. DE C.V.	mxAAA+	CB Corporativo	MPS	6.84%	6.84%	50,000	5,185,017.40	0.4%
D	91_BIMBO_17	GRUPO BIMBO S.A.B. DE C.V.	mxAAA+	CB Corporativo	MPS	6.70%	6.70%	80,500	9,023,890.69	0.6%
D	91_DAIMLER_18-4	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.24%	5.30%	160,000	17,286,360.00	1.2%
D	91_GAP_20-3	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	7.84%	7.84%	150,000	15,520,095.15	1.1%
D	91_KOF_13	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	A3	CB Corporativo	MPS	5.14%	5.14%	142,351	14,618,400.57	1.0%
D	91_KOF_17	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	6.13%	6.13%	125,500	13,983,557.76	1.0%
D	91_LALA_18	GRUPO LALA S.A.B. DE C.V.	F1+ (mex)	CB Corporativo	MPS	7.49%	7.49%	159,610	17,530,307.55	1.2%
D	91_TOYOTA_17-2	TOYOTA FINANCIAL SERVICIOS MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	6.04%	6.04%	100,000	10,732,009.40	0.7%
D	91_TOYOTA_17-3	TOYOTA FINANCIAL SERVICIOS MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.91%	5.91%	40,000	4,123,753.76	0.3%
D	94_COMPART_16-2	BANCO COMPARTAMOS S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE	AA (mex)	CB Bancario	MPS	6.45%	6.45%	150,000	15,946,620.90	1.1%
D	95_CDIVTOT_15U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TR/	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	2.02%	2.02%	84,935	23,012,369.67	1.6%
D	95_CDEVIS_10-4U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TR/	AAA (mex)	CB Paraestatal	MUD	1.38%	1.38%	86,000	9,777,232.76	0.7%
D	95_CDEVIS_11U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TR/	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	-0.35%	-0.35%	103,417	15,602,129.08	1.1%
D	95_CDEVIS_13U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TR/	A3	CB Paraestatal	MUD	1.99%	1.99%	14,224	2,740,515.76	0.2%
D	95_CFE_14-2	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	8.08%	8.08%	200,000	19,821,703.60	1.4%
D	95_CFE_15U	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	4.81%	4.81%	33,637	21,737,253.58	1.5%
D	95_CFE_17	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	8.38%	8.38%	236,000	23,757,766.00	1.6%
D	95_FEFA_15-5	FONDO ESPECIAL DE ASISTENCIA TECNICA Y GARANTIA PARA CF	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	5.61%	5.61%	355,000	38,511,006.34	2.6%
D	95_PEMEX_14-2	PETROLEOS MEXICANOS	AA+ (mex)	CB Paraestatal	MPS	12.40%	12.40%	300,000	24,444,010.20	1.7%
D	95_TFOVICB_12-3U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	2.08%	2.08%	177,297	22,289,108.66	1.5%
D	95_TFOVICB_13U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	2.17%	2.17%	198,794	43,520,715.63	3.0%
D	95_TFOVIS_12-4U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	3.97%	3.97%	119,353	17,845,221.34	1.2%
D	95_TFOVIS_14-2U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	1.78%	1.78%	50,967	16,888,868.60	1.2%
D	CD_BACMEXT_17-2	BANCO NACIONAL DE COMERCIO EXTERIOR S.N.C.	mxAAA	Cert. Depósito	MPS	5.30%	5.30%	500,000	54,505,389.00	3.7%
D	IS_BPA182_210909	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.41%	4.41%	70,000	7,008,520.47	0.5%
D	IS_BPA182_220310	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.39%	4.39%	500,000	50,075,175.50	3.4%
D	IS_BPA182_240307	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.54%	4.54%	1,750,000	174,481,205.50	12.0%
D	IS_BPA182_240905	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.26%	4.26%	500,000	50,335,422.50	3.5%
D	JE_AMX_1122	AMERICA MOVIL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	Tit. Cred Ext.	MPS	5.35%	5.35%	3,112	32,415,606.33	2.2%
D	JL_CABEI_1-17	BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA	mxAAA	Org Multilat.	MPS	4.08%	4.08%	200,000	20,075,286.40	1.4%
D	JL_CABEI_1-19	BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA	mxAAA	Org Multilat.	MPS	4.08%	4.08%	326,200	33,042,099.54	2.3%
D	M_BONOS_290531	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	5.64%	5.64%	500,000	60,994,856.50	4.2%
D	M_BONOS_310529	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	5.87%	5.87%	300,000	35,113,071.60	2.4%
D	S_UDIBONO_220609	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.23%	1.23%	197,044	131,303,704.47	9.0%
D	S_UDIBONO_231116	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.12%	1.12%	282,087	200,451,250.97	13.8%
D	S_UDIBONO_401115	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	3.04%	3.04%	41,827	31,636,949.41	2.2%
R	BI_CETES_201022	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	4.47%	4.39%	12,001,575	119,517,528.62	8.2%
Total							3.71%		1,454,321,160	100.0%

Activo Neto: 1,461,338,564
 VaR Autorizado (1 día) ⁽¹⁾: 18,997,401 1.300%
 Var Observado Promedio: 2,751,263 0.188%

Riesgo Crediticio	AAAf Sobresaliente	Calidad y diversificación de los activos del portafolio, fuerzas y debilidades de la administración y capacidad operativa.
Riesgo de Mercado	s5 - Alta	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%