finaccess
fondos de inversión

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

Cartera de Valores al 13/diciembre/2018

AXESLP | **Mediano plazo** | **AAAf/S6 (mex)**

Tenencia	Emisora	Calificación o Bursatilidad	Instrum Tenencia	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	%
D	**91_ACBE_17**	AAA (mex)	CB Corporativo	MXP	**10.08%**	**10.08%**	150,000	13,356,995	**0.9%**
D	**91_BBVALMX_18-2**	AAA (mex)	CB Corporativo	MXP	**10.02%**	**10.02%**	200,000	19,558,643.20	**1.3%**
D	**91_BIMBO_16**	AA+ (mex)	CB Corporativo	MXP	**10.18%**	**10.18%**	50,000	4,400,772.65	**0.3%**
D	**91_BIMBO_17**	AA+ (mex)	CB Corporativo	MXP	**10.34%**	**10.34%**	100,000	8,918,268.60	**0.6%**
D	**91_DAIMLER_18-4**	mxAAA	CB Corporativo	MXP	**9.57%**	**9.77%**	160,000	16,006,586.40	**1.0%**
D	**91_KOF_17**	mxAAA	CB Corporativo	MXP	**10.06%**	**10.06%**	150,000	13,684,102.80	**0.9%**
D	**91_LALA_18**	AA (mex)	CB Corporativo	MXP	**10.49%**	**10.49%**	190,000	17,983,419.63	**1.2%**
D	**91_LIVEPOL_17**	AAA (mex)	CB Corporativo	MXP	**10.15%**	**10.15%**	29,072	2,610,231.93	**0.2%**
D	**91_TOYOTA_17-2**	mxAAA	CB Corporativo	MXP	**10.28%**	**10.28%**	100,000	9,621,356.50	**0.6%**
D	**94_BACOMER_10U**	mxA-1	CB Bancario	MXP	**4.81%**	**4.81%**	49,230	30,302,308.80	**1.9%**
D	**94_COMPART_16-2**	AA+ (mex)	CB Bancario	MXP	**10.35%**	**10.35%**	150,000	13,602,591.45	**0.9%**
D	**95_CDVITOT_15U**	mxAAA	CB Paraestatal	MXP	**5.61%**	**5.61%**	84,935	25,152,831.64	**1.6%**
D	**95_CEDEVIS_09-3U**	AAA (mex)	CB Paraestatal	MXP	**6.93%**	**6.93%**	5,485	541,242.18	**0.0%**
D	**95_CEDEVIS_10-4U**	AAA (mex)	CB Paraestatal	MXP	**6.65%**	**6.65%**	86,000	26,776,496.72	**1.7%**
D	**95_CEDEVIS_11U**	AAA (mex)	CB Paraestatal	MXP	**5.84%**	**5.84%**	103,417	21,607,254.26	**1.4%**
D	**95_CEDEVIS_13U**	AAA (mex)	CB Paraestatal	MXP	**5.35%**	**5.35%**	14,224	3,247,393.51	**0.2%**
D	**95_CFE_14-2**	Aa1.mx	CB Paraestatal	MXP	**10.33%**	**10.33%**	200,000	17,107,171.40	**1.1%**
D	**95_CFE_15U**	AAA (mex)	CB Paraestatal	MXP	**5.34%**	**5.34%**	33,637	19,472,363.20	**1.3%**
D	**95_CFE_17**	Aa1.mx	CB Paraestatal	MXP	**10.38%**	**10.38%**	236,000	21,445,273.98	**1.4%**
D	**95_FEFA_15-5**	Aa1.mx	CB Paraestatal	MXP	**9.57%**	**9.57%**	355,000	32,625,639.91	**2.1%**
D	**95_PEMEX_14-2**	Aa3.mx	CB Paraestatal	MXP	**12.53%**	**12.53%**	400,000	30,115,488.80	**1.9%**
D	**95_TFOVICB_12-3U**	Aa3.mx	CB Paraestatal	MXP	**5.81%**	**5.81%**	177,297	38,517,105.73	**2.5%**
D	**95_TFOVICB_13U**	Aa3.mx	CB Paraestatal	MXP	**5.40%**	**5.40%**	198,794	56,885,784.16	**3.7%**
D	**95_TFOVIS_12-4U**	mxAAA	CB Paraestatal	MXP	**5.95%**	**5.95%**	119,353	28,294,488.05	**1.8%**
D	**95_TFOVIS_14-2U**	mxAAA	CB Paraestatal	MXP	**5.25%**	**5.25%**	50,967	19,132,159.89	**1.2%**
D	**CD_BACMEXT_17-2**	AAA (mex)	Cert. Depósito	MXP	**9.42%**	**9.42%**	500,000	47,489,607.50	**3.1%**
D	**IQ_BPAG91_210422**	AAA (mex)	Bonos IPAB 91	MXP	**8.39%**	**8.39%**	1,300,000	131,100,297.90	**8.4%**
D	**IS_BPA182_201022**	AAA (mex)	Bonos IPAB 182	MXP	**8.52%**	**8.52%**	200,000	20,195,321.40	**1.3%**
D	**IS_BPA182_210311**	AAA (mex)	Bonos IPAB 182	MXP	**8.38%**	**8.38%**	700,000	71,607,869.90	**4.6%**
D	**IS_BPA182_210909**	AAA (mex)	Bonos IPAB 182	MXP	**8.38%**	**8.38%**	70,000	7,165,436.39	**0.5%**
D	**IS_BPA182_220310**	AAA (mex)	Bonos IPAB 182	MXP	**8.38%**	**8.38%**	500,000	51,213,549.50	**3.3%**
D	**IS_BPA182_240307**	AAA (mex)	Bonos IPAB 182	MXP	**8.50%**	**8.50%**	1,750,000	178,726,910.25	**11.5%**
D	**IS_BPA182_240905**	AAA (mex)	Bonos IPAB 182	MXP	**8.46%**	**8.46%**	1,500,000	153,484,608.00	**9.9%**
D	**JE_AMX_1122**	mxAAA		MXP	**9.82%**	**9.82%**	1,060	9,450,248.96	**0.6%**
D	**JI_CABEI_1-15**	mxAAA	Org Multilat.	MXP	**8.28%**	**8.28%**	150,000	15,025,912.05	**1.0%**
D	**JI_CABEI_1-16**	mxAAA	Org Multilat.	MXP	**8.32%**	**8.32%**	226,500	22,698,317.43	**1.5%**
D	**JI_CABEI_2-15**	AAA (mex)	Org Multilat.	MXP	**8.28%**	**8.28%**	200,000	20,117,093.00	**1.3%**
D	**M_BONOS_241205**	AAA (mex)	Bonos M	MXP	**8.87%**	**8.87%**	1,200,000	126,287,173.20	**8.1%**
D	**M_BONOS_270603**	AAA (mex)	Bonos M	MXP	**8.96%**	**8.96%**	1,500,000	137,100,903.00	**8.8%**
D	**S_UDIBONO_220609**	AAA (mex)	Udibonos	MXP	**4.53%**	**4.53%**	17,219	9,800,477.19	**0.6%**
R	**M_BONOS_191211**	AAA (mex)	Reporto	MXP	**8.04%**	**8.56%**	662,999	64,043,540.03	**4.1%**
Total						**8.33%**		**1,556,473,236**	**100.0%**

Activo Neto:	**1,554,695,739**	
VaR Autorizado (1 día) [1]	**20,211,045**	**1.300%**
Var Observado Promedio:	**3,792,535**	**0.244%**

Riesgo Crediticio	**AAAf Sobresaliente**	Calidad y diversificación de los activos del portafolio, fuerzas y debilidades de la administración y capacidad operativa.
Riesgo de Mercado	**s6 - Muy Alta**	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%