

Latin 3 SA de CV, Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

Cartera de Valores al 17/septiembre/2020

AXESMP		Mediano plazo					AAAf/S3 (mex)			
Tenencia	Emisora/Serie	Descripción	Calificación o Bursatilidad	Tipo Instrumento	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	% Cartera
D	91_ACBE_17-2	AC BEBIDAS S. DE R.L. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.92%	4.92%	230,000	23,029,464	1.2%
D	91_BACHOCO_17	INDUSTRIAS BACHOCO S.A.B. DE C.V.	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	5.04%	5.04%	116,278	11,641,402.67	0.6%
D	91_CETELEM_19	CETELEM S.A. DE C.V. SOFOM E.R.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.49%	5.49%	350,000	34,876,849.00	1.8%
D	91_DAIMLER_18-3	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.31%	5.31%	80,000	8,028,745.52	0.4%
D	91_DAIMLER_19-2	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.31%	5.31%	93,911	9,417,460.63	0.5%
D	91_DAIMLER_19-3	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.31%	5.31%	50,000	4,998,638.00	0.3%
D	91_GAP_20	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.59%	5.59%	100,000	9,762,878.30	0.5%
D	91_GAL_20-2	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.59%	5.59%	100,000	10,001,611.80	0.5%
D	91_GRUMA_18	GRUMA S.A.B. DE C.V.	mxAAA+	CB Corporativo	MPS	5.10%	5.10%	219,630	22,044,184.91	1.2%
D	91_INCARSO_17	INMUEBLES CARSO S.A.B. DE C.V.	AA+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.09%	5.09%	260,000	13,052,007.54	0.7%
D	91_KOF_11-2	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.83%	4.83%	44,566	4,707,964.72	0.2%
D	91_KOF_13	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	A3	CB Corporativo	MPS	5.14%	5.14%	80,000	8,215,411.52	0.4%
D	91_KOF_17-2	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.82%	4.82%	215,000	21,648,634.66	1.1%
D	91_KOF_20-2	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.08%	5.08%	48,664	4,830,603.44	0.3%
D	91_LALA_18-2	GRUPO LALA S.A.B. DE C.V.	F1+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.41%	5.41%	230,000	22,993,212.24	1.2%
D	91_LIVEPOL_17-2	EL PUERTO DE LIVERPOOL S.A.B. DE C.V.	5.04%	CB Corporativo	MPS	5.04%	5.04%	226,269	22,694,656.93	1.2%
D	91_PCARFM_17	PACCAR FINANCIAL MEXICO S.A. DE C.V. SOFOM E.N.R.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.20%	5.20%	70,000	7,015,263.43	0.4%
D	91_SORIANA_15	ORGANIZACION SORIANA S.A.B. DE C.V.	AA+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.07%	5.07%	101,520	3,461,359.02	0.2%
D	91_TOYOTA_17-4	TOYOTA FINANCIAL SERVICES MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.20%	5.20%	179,942	12,049,023.03	0.6%
D	91_VWLEASE_17-2	VOLKSWAGEN LEASING S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.04%	5.04%	170,000	17,022,819.44	0.9%
D	92_FEFA_01520	FONDO ESPECIAL DE ASISTENCIA TECNICA Y GARANTIA PARA CF	Alta	CB Gubernamental	MPS	4.88%	4.88%	58,000	5,812,223.62	0.3%
D	94_BACOMER_17-2	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MPS	5.01%	5.01%	250,000	25,057,246.25	1.3%
D	94_BACOMER_18	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MPS	5.01%	5.01%	350,000	35,027,395.55	1.8%
D	94_BACOMER_18V	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MPS	5.01%	5.01%	250,000	25,032,183.50	1.3%
D	94_BACOMER_19	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MPS	5.01%	5.01%	250,000	24,938,998.25	1.3%
D	94_BINBUR_16-2	BANCO INBURSA S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO F	mxAAA	CB Bancario	MPS	4.79%	4.79%	380,000	38,110,451.56	2.0%
D	94_BLADEX_19	BANCO LATINOAMERICANO DE COMERCIO EXTERIOR S.A.	mxAAA	CB Bancario	MPS	5.10%	5.10%	242,452	24,356,315.75	1.3%
D	94_BSANT_16-2	BANCO SANTANDER (MEXICO) S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTI	A3	CB Bancario	MPS	4.90%	4.90%	280,000	28,089,272.12	1.5%
D	94_HSBC_19	HSBC MEXICO S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FIN	A3	CB Bancario	MPS	4.84%	4.84%	240,000	24,180,756.72	1.3%
D	94_HSBC_19-2	HSBC MEXICO S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FIN	A3	CB Bancario	MPS	4.90%	4.90%	200,000	20,109,329.40	1.1%
D	94_SCOTIAB_15-2	SCOTIABANK INVERLAT S.A. (MEXICO)	mxAAA	CB Bancario	MPS	4.59%	4.59%	234,603	23,556,781.89	1.2%
D	94_SCOTIAB_17-2	SCOTIABANK INVERLAT S.A. (MEXICO)	mxAAA	CB Bancario	MPS	5.04%	5.04%	252,434	25,330,299.90	1.3%
D	94_SCOTIAB_19	SCOTIABANK INVERLAT S.A. (MEXICO)	mxAAA	CB Bancario	MPS	5.04%	5.04%	300,000	29,943,067.20	1.6%
D	94_SCOTIAB_19-2	SCOTIABANK INVERLAT S.A. (MEXICO)	mxAAA	CB Bancario	MPS	5.04%	5.04%	250,000	24,934,649.75	1.3%
D	95_FEFA_17-5	FONDO ESPECIAL DE ASISTENCIA TECNICA Y GARANTIA PARA CF	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	5.10%	5.10%	210,000	21,043,095.57	1.1%
D	95_FNCOT_19	FIDEI. OPER. DEL FONDO DE FOMENTOS Y GARANTIA DE LOS TR	AAA (mex)	CB Paraestatal	MPS	4.91%	4.91%	100,000	10,039,471.80	0.5%
D	95_FNCOT_20	FIDEI. OPER. DEL FONDO DE FOMENTOS Y GARANTIA DE LOS TR	AAA (mex)	CB Paraestatal	MPS	5.23%	5.23%	220,000	22,094,420.70	1.2%
D	95_IFCOTCB_17	ACTINVER CASA DE BOLSA S.A. DE C.V.	AAA (mex)	CB Paraestatal	MPS	4.88%	4.87%	400,000	1,223,428.40	0.1%
D	95_TFOVCB_12-3U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	2.08%	2.08%	164,000	20,617,460.08	1.1%
D	BI_CETES_201008	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	4.41%	4.41%	16,000,000	159,609,104.00	8.4%
D	CD_NAFR_17S	NACIONAL FINANCIERA S.N.C. I.B.D.	mxAAA	Cert. Depósito	MPS	4.79%	4.79%	412,320	41,219,059.75	2.2%
D	IM_BPA628_210513	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.60%	4.60%	1,000,000	100,151,077.00	5.2%
D	IM_BPA628_220210	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.63%	4.63%	1,000,000	100,160,672.00	5.2%
D	IS_BPA182_201022	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.41%	4.41%	400,000	41,027,803.20	2.1%
D	IS_BPA182_210311	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.18%	4.18%	1,290,000	129,297,624.93	6.8%
D	IS_BPA182_220310	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.39%	4.39%	1,000,000	100,150,351.00	5.2%
D	IS_BPA182_270401	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.65%	4.65%	1,000,000	101,518,268.00	5.3%
D	JE_AMX_1122	AMERICA MOVIL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	Tit. Cred.Ext.	MPS	5.35%	5.35%	950	9,985,509.60	0.5%
D	JL_CABEI_1-17	BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA	mxAAA	Org Multilat.	MPS	4.08%	4.08%	650,000	65,244,680.80	3.4%
D	JL_CABEI_1-20	BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA	mxAAA	Org Multilat.	MPS	4.42%	4.42%	200,000	20,123,981.00	1.1%
D	LD_BONDES_230706	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.69%	4.68%	1,000,000	99,831,865.00	5.2%
D	LD_BONDES_230831	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.70%	4.70%	1,000,000	99,782,958.00	5.2%
D	S_UDIBONO_220609	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.23%	1.23%	32,218	21,469,025.96	1.1%
R	BI_CETES_201022	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	4.47%	4.39%	12,111,535	120,612,563.85	6.3%
Total								4.61%	1,911,083,583	100.0%

Activo Neto: 1,906,634,427
 VaR Autorizado (1 día) ⁽¹⁾: 3,813,269 0.200%
 Var Observado Promedio: 116,721 0.006%

Riesgo Crediticio	AAAf Sobresaliente	Calidad y diversificación de los activos del portafolio, fuerzas y debilidades de la administración y capacidad operativa.
Riesgo de Mercado	s3 - Moderada	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%