

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

Cartera de Valores al 31/agosto/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
R	BL_CETES_210331	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	4.53%	4.49%	17,589,387	171,378,639	7.7%
R	BL_CETES_210114	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	4.53%	4.49%	12,908,790	126,946,886.82	5.7%
D	LD_BONDESD_240627	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.67%	4.66%	700,000	69,646,029.60	3.1%
D	LD_BONDESD_230831	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.66%	4.65%	500,000	49,954,344.50	2.2%
D	LD_BONDESD_220428	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.60%	4.60%	1,500,000	149,996,020.50	6.8%
D	LD_BONDESD_220113	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.59%	4.58%	2,000,000	199,897,662.00	9.0%
D	LD_BONDESD_210819	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.57%	4.57%	500,000	50,044,369.50	2.3%
D	LD_BONDESD_210527	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.57%	4.56%	2,000,000	200,211,088.00	9.0%
D	LD_BONDESD_210325	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.56%	4.55%	1,750,000	175,370,912.50	7.9%
D	LD_BONDESD_201126	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.57%	4.56%	1,750,000	175,566,109.25	7.9%
D	LD_BONDESD_200917	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.54%	4.54%	1,000,000	100,149,442.00	4.5%
D	IS_BPA182_220908	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.57%	4.57%	500,000	51,603,809.50	2.3%
D	IQ_BPAG91_201224	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 91	MPS	4.40%	4.40%	1,000,000	101,149,830.00	4.6%
D	IM_BPAG28_230209	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.64%	4.64%	1,000,000	99,730,768.00	4.5%
D	IM_BPAG28_220512	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.59%	4.59%	1,000,000	100,209,983.00	4.5%
D	IM_BPAG28_210812	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.56%	4.56%	1,000,000	100,215,613.00	4.5%
D	IM_BPAG28_210513	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.55%	4.55%	1,000,000	100,336,656.00	4.5%
D	BI_CETES_201008	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	4.46%	4.46%	20,000,000	199,087,520.00	9.0%
Total							4.55%		2,221,495,683	100.0%

Activo Neto: 2,218,059,239
 VaR Autorizado (1 día) ⁽¹⁾: 332,709 0.015%
 Var Observado Promedio: 74,881 0.003%

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.

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%