

Latin 14 SA de CV, Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

Cartera de Valores al 31/agosto/2020

AXESCS		Deuda Discrecional					AAAf/S4(mex)			
Tenencia	Emisora/Serie	Descripción	Calificación o Bursatilidad	Tipo Instrumento	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	% Cartera
R	BL_CETES_210114	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	4.53%	4.49%	18,643,522	183,343,061	17.6%
D	S_UDIBONO_251204	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.46%		47,791	36,356,733.52	3.5%
D	S_UDIBONO_231116	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.05%		108,632	77,145,721.78	7.4%
D	S_UDIBONO_220609	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.07%		160,742	107,111,556.73	10.3%
D	M_BONOS_290531	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	5.83%	5.83%	67,313	8,091,750.05	0.8%
D	LD_BONDES_210121	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.58%	4.57%	280,000	28,087,441.76	2.7%
D	LD_BONDES_201126	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.57%	4.56%	31,086	3,118,656.04	0.3%
D	IQ_BPAG91_211223	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 91	MPS	4.54%	4.54%	23,856	2,410,828.91	0.2%
D	BL_CETES_210128	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	4.49%	4.49%	2,163,594	21,241,200.93	2.0%
D	BL_CETES_210114	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	4.49%	4.49%	3,919,305	38,544,095.40	3.7%
D	BL_CETES_201231	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	4.47%	4.47%	3,912,595	38,546,964.19	3.7%
D	BL_CETES_201217	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	4.46%	4.46%	2,216,854	21,878,486.82	2.1%
D	95_CFE_10-2	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	5.76%	5.76%	282,069	28,974,120.63	2.8%
D	91_VWLEASE_17-2	VOLKSWAGEN LEASING S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.07%	5.07%	410,000	41,140,186.79	4.0%
D	91_LIVEPOL_17-2	EL PUERTO DE LIVERPOOL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.07%	5.07%	551,637	55,196,912.41	5.3%
D	91_LALA_18-2	GRUPO LALA S.A.B. DE C.V.	F1+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.44%	5.44%	637,879	63,605,811.70	6.1%
D	91_INCARSO_17	INMUEBLES CARSO S.A.B. DE C.V.	AA+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.11%	5.11%	450,000	22,634,933.85	2.2%
D	91_GRUMA_18	GRUMA S.A.B. DE C.V.	mxAAA+	CB Corporativo	MPS	5.13%	5.13%	536,628	53,731,000.59	5.2%
D	91_GMXT_17-2	GMEXICO TRANSPORTES S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.98%	4.98%	363,883	36,402,897.17	3.5%
D	91_FUNO_17-2	FIBRA UNO ADMINISTRACION S.A. DE C.V.	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	5.26%	5.26%	586,123	59,220,449.50	5.7%
D	91_FHIPO_16	BANCO INVEX S.A.	A3	CB Corporativo	MPS	5.81%	5.81%	193,419	19,762,678.78	1.9%
D	91_DAIMLER_19	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.30%	5.36%	185,114	20,319,112.81	2.0%
D	91_CETEM_18	CETEM S.A. DE C.V. SOFOM E.R.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.47%	5.47%	489,792	48,909,070.11	4.7%
D	91_BACHOCO_17	INDUSTRIAS BACHOCO S.A.B. DE C.V.	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	5.07%	5.07%	236,436	23,714,835.57	2.3%
Total								3.90%	1,039,488,507	100.0%

Activo Neto: 1,037,790,151
 VaR Autorizado (1 día) ⁽¹⁾: 15,566,852 1.500%
 Var Observado Promedio: 290,364 0.028%

Riesgo Crediticio	AAAf Sobresaliente	Calidad y diversificación de los activos del portafolio, fuerzas y debilidades de la administración y capacidad operativa.
Riesgo de Mercado	s4 - 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%