

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

Cartera de Valores al 31/agosto/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
R	BL_CETES_210114	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	4.53%	4.49%	16,263,869	159,941,213	11.1%
D	S_UDIBONO_401115	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	3.03%		41,827	31,566,271.23	2.2%
D	S_UDIBONO_231116	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.05%		282,087	200,325,918.87	13.9%
D	S_UDIBONO_220609	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.07%		92,053	61,340,160.83	4.2%
D	M_BONOS_310529	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	6.07%	6.07%	300,000	34,499,547.90	2.4%
D	M_BONOS_290531	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	5.83%	5.83%	600,000	72,126,484.20	5.0%
D	JL_CABEL_1-19	BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA	mxAAA	Org Multilat.	MPS	4.11%	4.11%	326,200	32,978,010.05	2.3%
D	JL_CABEL_1-17	BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA	mxAAA	Org Multilat.	MPS	4.11%	4.11%	200,000	20,036,357.60	1.4%
D	JE_AMX_1122	AMERICA MOVIL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	Ti.Cred.Ext.	MPS	5.42%	5.42%	3,112	32,287,799.61	2.2%
D	IS_BPA182_240905	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.35%	4.35%	500,000	51,948,477.00	3.6%
D	IS_BPA182_240307	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.63%	4.63%	1,750,000	180,110,591.50	12.5%
D	IS_BPA182_220310	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.48%	4.48%	500,000	51,686,230.50	3.6%
D	IS_BPA182_210909	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.50%	4.50%	70,000	7,234,008.46	0.5%
D	CD_BACMEXT_17-2	BANCO NACIONAL DE COMERCIO EXTERIOR S.N.C.	mxAAA	Cert. Depósito	MPS	5.46%	5.46%	500,000	54,084,437.50	3.7%
D	95_TFOVIS_14-2U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	1.32%	1.32%	50,967	16,989,668.82	1.2%
D	95_TFOVIS_12-4U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	3.81%	3.81%	119,353	17,803,051.78	1.2%
D	95_TFOVICB_13U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	2.01%	2.01%	198,794	49,489,930.59	3.0%
D	95_TFOVICB_12-3U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	1.92%	1.92%	177,297	22,243,297.59	1.5%
D	95_PEMEX_14-2	PETROLEOS MEXICANOS	AA+ (mex)	CB Paraestatal	MPS	12.55%	12.55%	300,000	24,143,282.70	1.7%
D	95_FEFA_15-5	FONDO ESPECIAL DE ASISTENCIA TECNICA Y GARANTIA PARA CF	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	5.77%	5.77%	355,000	38,153,117.35	2.6%
D	95_CFE_17	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	8.59%	8.59%	236,000	23,402,135.48	1.6%
D	95_CFE_15U	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	4.47%	4.47%	33,637	22,092,959.10	1.5%
D	95_CFE_14-2	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	8.24%	8.24%	200,000	19,614,875.00	1.4%
D	95_CEDAVIS_13U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TR/	A3	CB Paraestatal	MUD	1.93%	1.93%	14,224	2,736,833.20	0.2%
D	95_CEDAVIS_11U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TR/	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	0.05%	0.05%	103,417	15,511,175.38	1.1%
D	95_CEDAVIS_10-4U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TR/	AAA (mex)	CB Paraestatal	MUD	1.22%	1.22%	86,000	9,757,764.51	0.7%
D	95_CDIVTOT_15U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TR/	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	1.78%	1.78%	84,935	23,072,087.30	1.6%
D	94_COMPART_16-2	BANCO COMPARTAMOS S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE	AA (mex)	CB Bancario	MPS	6.56%	6.56%	150,000	15,852,046.80	1.1%
D	91_TOYOTA_17-3	TOYOTA FINANCIAL SERVICIOS MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.98%	5.98%	40,000	4,108,376.12	0.3%
D	91_TOYOTA_17-2	TOYOTA FINANCIAL SERVICIOS MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	6.15%	6.15%	100,000	11,109,036.80	0.8%
D	91_LALA_18	GRUPO LALA S.A.B. DE C.V.	F1+	CB Corporativo	MPS	7.20%	7.20%	159,610	18,491,877.35	1.3%
D	91_KOF_17	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	6.32%	6.32%	125,500	13,804,449.56	1.0%
D	91_KOF_13	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	A3	CB Corporativo	MPS	5.26%	5.26%	142,351	14,540,245.45	1.0%
D	91_GAP_20-3	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	8.03%	8.03%	150,000	15,313,768.95	1.1%
D	91_DAMLER_18-4	DAMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.30%	5.36%	160,000	17,233,609.76	1.2%
D	91_BIMBO_17	GRUPO BIMBO S.A.B. DE C.V.	mxAAA+	CB Corporativo	MPS	6.89%	6.89%	80,500	8,906,106.55	0.6%
D	91_BIMBO_16	GRUPO BIMBO S.A.B. DE C.V.	mxAAA+	CB Corporativo	MPS	7.00%	7.00%	50,000	5,319,439.45	0.4%
D	91_BVALMIX_18-2	BVA LEASING SA DE CV	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	6.09%	6.09%	300,000	33,014,358.30	2.3%
D	91_ACBE_17	AC BEBIDAS S. DE R.L. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	6.65%	6.65%	150,000	16,559,098.10	1.1%
Total							3.98%		1,443,428,098	100.0%

Activo Neto: 1,460,024,188
 VaR Autorizado (1 día) ⁽¹⁾: 18,980,314 1.300%
 Var Observado Promedio: 2,717,058 0.186%

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%