finaccess
fondos de inversión

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

Cartera de Valores al 27/marzo/2024

AXESLP | **Largo Plazo** | **AAAf/S5 (mex)**

Tenencia	Emisora/Serie	Descripción	Calificación o Bursatilidad	Tipo instrumento	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	% Cartera
D	1ISP_VGSH_*	VANGUARD SHORT TERM TREASURY ETF	Alta	ETF SIC	USD			86,875	83,626,961	4.9%
D	91_ACBE_17	AC BEBIDAS S. DE R.L. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	10.06%	10.06%	235,000	22,122,841.02	1.3%
D	91_AMX_22X	AMERICA MOVIL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	9.68%	9.68%	350,000	35,832,091.40	2.1%
D	91_BBVALMX_18-2	BBVA LEASING SA DE CV	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	11.65%	11.65%	300,000	29,963,441.70	1.8%
D	91_BIMBO_16	GRUPO BIMBO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	10.57%	10.57%	50,000	4,708,580.90	0.3%
D	91_BIMBO_17	GRUPO BIMBO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	9.96%	9.96%	80,500	7,969,912.32	0.5%
D	91_BIMBO_23L	GRUPO BIMBO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	9.78%	9.78%	55,000	5,492,553.83	0.3%
D	91_CETELEM_22-4	CETELEM S.A. DE C.V. SOFOM E.R.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	10.39%	10.39%	168,000	17,721,593.90	1.0%
D	91_FEMSA_22-2L	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO S.A.B. DE C.V (FEMSA)	mxAAA	CB Corporativo	MPS	9.71%	9.71%	250,000	25,839,348.25	1.5%
D	91_GAP_20-3	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	10.42%	10.42%	150,000	14,418,103.20	0.8%
D	91_GAP_22-2	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	9.87%	9.87%	130,000	12,919,508.94	0.8%
D	91_GPH_19-2	GRUPO PALACIO DE HIERRO SAB DE CV	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	10.05%	10.05%	168,000	15,865,412.14	0.9%
D	91_KIMBER_22	KIMBERLY CLARK DE MEXICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	9.92%	9.92%	260,000	25,438,908.82	1.5%
D	91_KOF_17	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	10.24%	10.24%	125,500	12,017,390.05	0.7%
D	91_KOF_22S	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	9.53%	9.53%	103,260	11,009,360.22	0.6%
D	91_LIVEPOL_19	EL PUERTO DE LIVERPOOL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	10.42%	10.42%	170,000	15,782,311.42	0.9%
D	94_BANORTE_24-2X	BANCO MERCANTIL DEL NORTE S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE	A3	CB Bancario	MPS	9.80%	9.80%	336,000	33,874,729.73	2.0%
D	94_BLADEX_23-3	BANCO LATINOAMERICANO DE COMERCIO EXTERIOR S.A.	mxAAA	CB Bancario	MPS	10.11%	10.11%	340,000	36,723,460.18	2.1%
D	94_BSANT_16-3	BANCO SANTANDER (MEXICO) S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE (	A3	CB Bancario	MPS	10.53%	10.53%	98,000	9,296,735.31	0.5%
D	95_CDVITOT_15U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TRABAJA	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	10.46%	10.46%	84,935	7,843,562.86	0.5%
D	95_CEDEVIS_13U	INSTITUTO DEL FONDO NACIONAL DE LA VIVIENDA PARA LOS TRABAJA	A3	CB Paraestatal	MUD	7.31%	7.31%	14,224	1,424,922.20	0.1%
D	95_CFE_15U	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	6.52%	6.52%	33,637	25,877,477.55	1.5%
D	95_CFE_17	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	11.00%	11.00%	236,000	22,089,162.22	1.3%
D	95_FEFA_15-5	FONDO ESPECIAL PARA FINACIAMIENTOS AGROPECUARIOS (FEFA)	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	10.49%	10.49%	355,000	34,405,304.61	2.0%
D	95_FEFA_20-4	FONDO ESPECIAL PARA FINACIAMIENTOS AGROPECUARIOS (FEFA)	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	10.44%	10.44%	28,168	2,675,836.60	0.2%
D	95_PEMEX_14-2	PETROLEOS MEXICANOS	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	12.70%	12.70%	300,000	27,404,603.40	1.6%
D	95_TFOVIS_14-2U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVICIOS S	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	6.31%	6.31%	50,967	8,628,062.46	0.5%
D	CD_BACMEXT_17-2	BANCO NACIONAL DE COMERCIO EXTERIOR S.N.C.	mxAAA	Cert. Depósito	MPS	11.34%	11.34%	500,000	50,650,912.50	3.0%
D	CD_BACMEXT_20-2	BANCO NACIONAL DE COMERCIO EXTERIOR S.N.C.	mxAAA	Cert. Depósito	MPS	10.09%	10.09%	280,000	24,700,247.04	1.4%
D	D2_GS623_371111	GS FINANCE CORPORATION	Alta	EBono Priv	MUD	5.35%	5.35%	14	37,505,373.76	2.2%
D	IS_BPA182_240905	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	11.08%	11.08%	500,000	50,414,325.00	2.9%
D	M_BONOS_260305	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	10.05%	10.05%	500,000	46,468,240.00	2.7%
D	M_BONOS_270304	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	9.44%	9.44%	1,000,000	90,392,812.00	5.3%
D	M_BONOS_290531	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	9.23%	9.23%	750,000	74,803,103.25	4.4%
D	M_BONOS_310529	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	9.26%	9.26%	1,600,000	151,395,609.60	8.9%
D	M_BONOS_330526	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	9.24%	9.24%	1,600,000	146,733,611.20	8.6%
D	S_UDIBONO_261203	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	5.89%		272,731	207,715,696.02	12.1%
D	S_UDIBONO_281130	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	5.09%		173,192	136,027,544.11	8.0%
D	S_UDIBONO_311127	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	4.91%		14,822	10,477,271.69	0.6%
D	S_UDIBONO_401115	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	4.83%		28,846	21,493,028.46	1.3%
R	IS_BPA182_260219	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	11.06%	11.30%	1,085,388	110,015,788.39	6.4%
Total							**7.20%**		**1,709,765,739**	**100.0%**

Activo Neto:	1,700,047,239	
VaR Autorizado (1 día) [1]	22,100,614	1.300%
Var Observado Promedio:	6,409,243	0.377%

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.

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%