

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

Cartera de Valores al 31/agosto/2020

AXESMP		Mediano plazo					AAAf/S3 (mex)			
Tenencia	Emisora/Serie	Descripción	Calificación o Bursatilidad	Tipo instrumento	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Títulos	Valor Razonable	% Cartera
R	BL_CETES_210114	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	4.53%	4.49%	14,826,674	145,807,632	7.4%
D	S_UDIBONO_220609	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.07%		32,218	21,468,689.79	1.1%
D	LD_BONDESD_230831	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.66%	4.65%	1,000,000	99,908,689.00	5.1%
D	LD_BONDESD_230706	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonde LD	MPS	4.65%	4.65%	1,000,000	99,945,440.00	5.1%
D	JL_CABEL_1-20	BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA	mxAAA	Orig Multilat.	MPS	4.49%	4.49%	200,000	20,140,452.20	1.0%
D	JL_CABEL_1-17	BANCO CENTROAMERICANO DE INTEGRACION ECONOMICA	mxAAA	Orig Multilat.	MPS	4.11%	4.11%	650,000	65,118,162.20	3.3%
D	JE_AMX_1122	AMERICA MOVIL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	Til.Cred.Ext.	MPS	5.42%	5.42%	950	9,856,494.10	0.5%
D	IS_BPA182_270401	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.75%	4.75%	1,000,000	101,250,822.00	5.1%
D	IS_BPA182_220310	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.48%	4.48%	1,000,000	103,372,461.00	5.3%
D	IS_BPA182_210311	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.27%	4.27%	1,290,000	133,466,614.68	6.8%
D	IS_BPA182_201022	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos IPAB 182	MPS	4.50%	4.50%	400,000	40,938,283.20	2.1%
D	IM_BPAG28_220210	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 28	MPS	4.58%	4.58%	1,000,000	99,942,038.00	5.1%
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	5.1%
D	CD_NAFR_17S	NACIONAL FINANCIERA S.N.C. I.B.D.	mxAAA	Cert. Depósito	MPS	4.82%	4.82%	412,320	41,289,491.01	2.1%
D	BI_CETES_201008	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	4.46%	4.46%	16,000,000	159,270,016.00	8.1%
D	95_TFOVICB_12-3U	FONDO DE LA VIVIENDA DEL INSTITUTO DE SEGURIDAD Y SERVIC	mxAAA	CB Paraestatal	MUD	1.92%	1.92%	164,000	20,975,088.78	1.0%
D	95_IFCOTCB_17	ACTINVER CASA DE BOLSA S.A. DE C.V.	AAA (mex)	CB Paraestatal	MPS	4.90%	4.90%	400,000	4,557,568.80	0.2%
D	95_FNCOT_20	FIDEI. OPER. DEL FONDO DE FOMENTOS Y GARANTIA DE LOS TR	AAA (mex)	CB Paraestatal	MPS	5.27%	5.27%	220,000	22,035,739.66	1.1%
D	95_FNCOT_19	FIDEI. OPER. DEL FONDO DE FOMENTOS Y GARANTIA DE LOS TR	AAA (mex)	CB Paraestatal	MPS	4.93%	4.93%	100,000	10,106,157.40	0.5%
D	95_FEFA_17-5	FONDO ESPECIAL DE ASISTENCIA TECNICA Y GARANTIA PARA CF	mxAAA	CB Paraestatal	MPS	5.08%	5.08%	210,000	21,092,469.09	1.1%
D	94_SCOTIAB_19-2	SCOTIABANK INVERLAT S.A. (MEXICO)	mxAAA	CB Bancario	MPS	5.07%	5.07%	250,000	24,977,891.50	1.3%
D	94_SCOTIAB_19	SCOTIABANK INVERLAT S.A. (MEXICO)	mxAAA	CB Bancario	MPS	5.07%	5.07%	300,000	29,995,239.60	1.5%
D	94_SCOTIAB_17-2	SCOTIABANK INVERLAT S.A. (MEXICO)	mxAAA	CB Bancario	MPS	5.07%	5.07%	252,434	25,372,830.74	1.3%
D	94_SCOTIAB_15-2	SCOTIABANK INVERLAT S.A. (MEXICO)	mxAAA	CB Bancario	MPS	4.62%	4.62%	234,603	23,505,459.44	1.2%
D	94_HSBC_19-2	HSBC MEXICO S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FIN	A3	CB Bancario	MPS	4.93%	4.93%	200,000	20,622,652.00	1.0%
D	94_HSBC_19	HSBC MEXICO S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FIN	A3	CB Bancario	MPS	4.87%	4.87%	240,000	24,125,296.08	1.2%
D	94_BSANT_16-2	BANCO SANTANDER (MEXICO) S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTI	A3	CB Bancario	MPS	5.01%	5.01%	280,000	28,127,255.24	1.4%
D	94_BLADEX_19	BANCO LATINOAMERICANO DE COMERCIO EXTERIOR S.A.	mxAAA	CB Bancario	MPS	5.13%	5.13%	242,452	24,297,523.81	1.2%
D	94_BINBUR_16-2	BANCO INBURSA S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO F	mxAAA	CB Bancario	MPS	4.82%	4.82%	380,000	38,185,725.38	1.9%
D	94_BACOMER_19	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MPS	5.00%	5.00%	250,000	24,998,317.50	1.3%
D	94_BACOMER_18V	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MPS	4.94%	4.94%	250,000	24,998,825.75	1.3%
D	94_BACOMER_18	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MPS	5.00%	5.00%	350,000	34,984,287.10	1.8%
D	94_BACOMER_17-2	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MPS	4.97%	4.97%	250,000	25,132,692.75	1.3%
D	92_FEFA_01520	FONDO ESPECIAL DE ASISTENCIA TECNICA Y GARANTIA PARA CF	AAA (mex)	CB Gubernamental	MPS	4.91%	4.91%	58,000	5,822,856.76	0.3%
D	91_VWLEASE_17-2	VOLKSWAGEN LEASING S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.07%	5.07%	170,000	17,058,126.23	0.9%
D	91_TOYOTA_17-4	TOYOTA FINANCIAL SERVICIOS MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.23%	5.23%	179,942	12,018,925.03	0.6%
D	91_SORIANA_15	ORGANIZACION SORIANA S.A.B. DE C.V.	AA+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.10%	5.10%	101,520	3,468,419.43	0.2%
D	91_PCAREFM_17	PACCAR FINANCIAL MEXICO S.A. DE C.V. SOFOM E.N.R.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.23%	5.23%	70,000	7,028,675.64	0.4%
D	91_NRF_17	NR FINANCE MEXICO S.A. DE C.V.	AA+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.82%	5.82%	220,000	22,038,457.32	1.1%
D	91_LIVEPOL_17-2	EL PUERTO DE LIVERPOOL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.07%	5.07%	226,269	22,640,522.98	1.2%
D	91_LALA_18-2	GRUPO LALA S.A.B. DE C.V.	FT+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.44%	5.44%	230,000	22,934,344.43	1.2%
D	91_KOF_20-2	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.10%	5.10%	48,664	4,819,037.52	0.2%
D	91_KOF_17-2	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.84%	4.84%	215,000	21,599,261.20	1.1%
D	91_KOF_13	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	A3	CB Corporativo	MPS	5.26%	5.26%	80,000	8,171,489.04	0.4%
D	91_KOF_11-2	COCA-COLA FEMSA S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.88%	4.88%	44,566	4,696,038.10	0.2%
D	91_INCARSO_17	INMUEBLES CARSO S.A.B. DE C.V.	AA+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.11%	5.11%	260,000	13,077,961.78	0.7%
D	91_GRUMA_18	GRUMA S.A.B. DE C.V.	mxAAA+	CB Corporativo	MPS	5.13%	5.13%	219,630	21,990,913.00	1.1%
D	91_GAP_20-2	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.62%	5.62%	100,000	10,018,871.40	0.5%
D	91_GAP_20	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.62%	5.62%	100,000	9,737,320.30	0.5%
D	91_DAIMLER_19-3	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.34%	5.34%	50,000	5,007,973.10	0.3%
D	91_DAIMLER_19-2	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.34%	5.34%	93,911	9,393,777.87	0.5%
D	91_DAIMLER_18-3	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.34%	5.34%	80,000	8,008,554.56	0.4%
D	91_CETELM_19	CETELM S.A. DE C.V. SOFOM E.R.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.52%	5.52%	350,000	34,937,193.90	1.8%
D	91_BACHOCO_17	INDUSTRIAS BACHOCO S.A.B. DE C.V.	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	5.07%	5.07%	116,278	11,662,833.28	0.6%
D	91_ACBE_17-2	AC BEBIDAS S. DE R.L. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.95%	4.95%	23,071,145.21	23,071,145.21	1.2%
Total							4.65%	230,000	1,968,355,656	100.0%

Activo Neto: 1,966,731,552
VaR Autorizado (1 día) ⁽¹⁾ 3,933,463 0.200%
Var Observado Promedio: 114,636 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%