

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

Cartera de Valores al 17/junio/2021

AXESCSD			Deuda Discrecional					AAAf/S4(mex)		
Tenencia	Emisora/Serie	Descripción	Calificación o Bursatilidad	Tipo instrumento	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	% Cartera
D	91_BACHOCO_17	INDUSTRIAS BACHOCO S.A.B. DE C.V.	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	4.59%	4.59%	236,436	23,730,863	4.0%
D	91_DAIMLER_19	DAIMLER MEXICO S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	5.14%	5.20%	185,114	19,484,061.71	3.3%
D	91_FHIPO_16	BANCO INVEX S.A.	A3	CB Corporativo	MPS	5.17%	5.17%	193,419	19,988,608.03	3.4%
D	91_FUNO_17-2	FIBRA UNO ADMINISTRACION S.A. DE C.V.	AAA (mex)	CB Corporativo	MPS	5.41%	5.41%	386,123	38,600,934.08	6.5%
D	91_GMXT_17-2	GMEXICO TRANSPORTES S.A. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.50%	4.50%	363,883	36,449,303.53	6.2%
D	91_GRUMA_18	GRUMA S.A.B. DE C.V.	mxAAA+	CB Corporativo	MPS	4.65%	4.65%	316,628	31,737,276.60	5.4%
D	91_INCARSO_17	INMUEBLES CARSO S.A.B. DE C.V.	AA+ (mex)	CB Corporativo	MPS	4.64%	4.64%	450,000	22,538,371.50	3.8%
D	91_LALA_18-2	GRUPO LALA S.A.B. DE C.V.	F1+ (mex)	CB Corporativo	MPS	5.01%	5.01%	312,468	31,204,418.09	5.3%
D	91_LIVEPOL_17-2	EL PUERTO DE LIVERPOOL S.A.B. DE C.V.	mxAAA	CB Corporativo	MPS	4.59%	4.59%	351,637	35,236,528.24	6.0%
D	94_BACOMER_07U	BBVA BANCOMER S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO	A3	CB Bancario	MUD	2.52%	2.52%	33,305	25,128,592.93	4.3%
D	IQ_BPAG91_211223	INSTITUTO PARA LA PROTECCION AL AHORRO BANCARIO	mxAAA	Bonos IPAB 91	MPS	4.17%	4.17%	23,856	2,407,530.22	0.4%
D	M_BONOS_231207	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	5.42%	5.42%	300,000	31,843,230.00	5.4%
D	M_BONOS_241205	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	5.87%	5.87%	360,000	40,741,113.96	6.9%
D	M_BONOS_260305	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Bonos M	MPS	6.18%	6.18%	700,000	69,869,671.20	11.8%
D	S_UDIBONO_220609	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	0.79%		73,058	50,418,426.49	8.5%
D	S_UDIBONO_231116	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Udibonos	MUD	1.04%		106,397	77,035,515.77	13.1%
R	BI_CETES_210729	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	3.90%	4.04%	3,369,101	33,537,422.79	5.7%
Total							3.91%		589,951,868	100.0%

Activo Neto:	589,435,002	
VaR Autorizado (1 día) <sup>(1)</sup>	8,841,525	1.500%
Var Observado Promedio:	472,399	0.080%

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%