

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

Cartera de Valores al 13/junio/2019

AXESCSD Deuda Discrecional AAaf/S5 (mex)

Tenencia	Emisora/Serie	Calificación o Bursatilidad	Tipo instrumento	Divisa	Tasa Cupón	Tasa Mercado	Titulos	Valor Razonable	% Cartera
D	91_AMX_10-2	mxAAA	CB Corporativo	MXN	9.05%	9.05%	356,713	36,519,920	2.3%
D	91_ARCA_10	mxAAA	CB Corporativo	MXN	8.71%	8.71%	53,456	5,308,131.62	0.3%
D	91_BACHOCO_17	AAA (mex)	CB Corporativo	MXN	8.77%	8.77%	266,436	26,821,218.76	1.7%
D	91_CETEM_18	mxAAA	CB Corporativo	MXN	8.87%	8.87%	489,792	49,056,652.77	3.1%
D	91_DAIMLER_19	mxAAA	CB Corporativo	MXN	8.51%	8.66%	585,114	60,422,968.02	3.9%
D	91_FHIPO_16	A3	CB Corporativo	MXN	9.20%	9.20%	193,419	19,172,965.91	1.2%
D	91_FORD_17	AA+ (mex)	CB Corporativo	MXN	9.14%	9.14%	250,000	25,010,914.75	1.6%
D	91_FUNO_17-2	AAA (mex)	CB Corporativo	MXN	9.21%	9.21%	586,123	59,151,536.09	3.8%
D	91_GMXT_17-2	mxAAA	CB Corporativo	MXN	8.75%	8.75%	863,883	86,457,021.89	5.5%
D	91_GRUMA_18	mxAA+	CB Corporativo	MXN	8.86%	8.86%	536,628	53,827,175.60	3.4%
D	91_INCARSO_17	AA+ (mex)	CB Corporativo	MXN	8.92%	8.92%	450,000	45,068,471.55	2.9%
D	91_KIMBER_09-4	mxAAA	CB Corporativo	MXN	8.85%	8.85%	619,015	63,317,806.94	4.0%
D	91_LALA_18-2	AA (mex)	CB Corporativo	MXN	9.00%	9.00%	637,879	63,994,292.77	4.1%
D	91_LIVEPOL_17-2	mxAAA	CB Corporativo	MXN	8.80%	8.80%	551,637	55,282,984.33	3.5%
D	91_SORIANA_15	AA+ (mex)	CB Corporativo	MXN	8.88%	8.88%	586,090	39,349,056.94	2.5%
D	91_VWLEASE_17-2	mxAAA	CB Corporativo	MXN	8.90%	8.90%	410,000	41,325,588.79	2.6%
D	94_BANOB_11-2	mxAAA	CB Bancario	MXN	8.13%	8.13%	388,409	38,220,773.96	2.4%
D	95_CFE_10-2	mxAAA	CB Paraestatal	MXN	8.42%	8.42%	282,069	28,160,875.37	1.8%
D	95_CFE_09U	mxAAA	CB Paraestatal	MXN	0.34%	0.34%	22,347	715,456.12	0.0%
D	95_FEFA_17-4	mxAAA	CB Paraestatal	MXN	8.60%	8.60%	227,034	22,832,781.68	1.5%
D	95_FEFA_17-5	mxAAA	CB Paraestatal	MXN	8.79%	8.79%	400,000	40,351,123.20	2.6%
D	BI_CETES_190620	mxAAA	Cete	MXN	8.24%	8.24%	10,000,000	99,862,900.00	6.4%
D	IQ_BPAG91_211223	mxAAA	Bonos IPAB 91	MXN	8.37%	8.37%	23,856	2,423,040.99	0.2%
D	JL_CABEL_1-15	mxAAA	Org Multilat.	MXN	8.25%	8.25%	78,757	7,916,157.00	0.5%
D	LD_BONDESD_190627	mxAAA	Bonde LD	MXN	8.29%	8.26%	900,000	90,312,374.70	5.8%
D	LD_BONDESD_190808	mxAAA	Bonde LD	MXN	8.31%	8.29%	2,000,000	200,038,274.00	12.8%
D	LD_BONDESD_191226	mxAAA	Bonde LD	MXN	8.32%	8.30%	27,127	2,712,818.00	0.2%
D	LD_BONDESD_201126	mxAAA	Bonde LD	MXN	8.34%	8.32%	31,086	3,106,867.89	0.2%
D	LD_BONDESD_210121	mxAAA	Bonde LD	MXN	8.34%	8.32%	280,000	27,981,801.12	1.8%
D	S_UDIBONO_201210	mxAAA	Udibonos	MXN	3.39%	3.39%	256,197	158,304,446.29	10.1%
R	IM_BPAG28_210211	mxAAA	Reporto	MXN	8.23%	8.33%	1,149,083	115,003,346.40	7.3%
Total						8.09%		1,568,029,744	100.0%

Activo Neto: 1,567,184,806
VaR Autorizado (1 día) ⁽¹⁾ 23,507,772 1.500%
Var Observado Promedio: 445,568 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	s5 - Alta	Sensibilidad ante las condiciones cambiantes en los factores de mercado.

"El fondo no se encuentra en una estrategia temporal de inversión.

CARLOS H. RODRIGUEZ GIACINTI
DIRECTOR DE LAS SOCIEDADES

(1) Metodología para el cálculo del VaR: Simulación histórica con 500 escenarios y un nivel de confianza del 95%