finaccess
fondos de inversión

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

Cartera de Valores al 27/marzo/2024

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	BI_CETES_240530	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	11.10%	11.10%	40,000	392,875	34.9%
D	BI_CETES_250320	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Cete	MPS	10.87%	10.87%	65,000	587,233.21	52.1%
R	IS_BPA182_260219	SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO	mxAAA	Reporto	MPS	11.06%	11.30%	1,452	147,175.87	13.1%
	—									
	—									
	—									
	—									
	—									
	—									
	—									
	—									
	—									
	—									
Total							**11.01%**		**1,127,284**	**100.0%**

Activo Neto:	1,089,069	
VaR Autorizado (1 día) (1)	16,336	1.500%
Var Observado Promedio:	764	0.070%

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.

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%