

**CARTERA MENSUAL
LATAMCB
AGOSTO 2019**



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE		2,558,736	5.310%
2U	CBIC002 300117 mxAAA	2,558,736	5.310%
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)		45,032,926	93.451%
56SP	SANHYDI LX NA	45,032,926	93.451%
INVERSION EN DOLARES		597,017	1.239%
CHD	BSANT 2945007	597,017	1.239%
TOTAL CARTERA		48,188,678	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		48,203,569	
VAR ESTABLECIDO			2.700%
VAR OBSERVADO (Promedio)			1.333%

Cartera al 30/08/2019 FONDO SAM DEUDA 5, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

El Valor en Riesgo se estima utilizando la metodología de Simulación Histórica de 500 escenarios con un nivel de confianza del 95% a dos colas. El VaR Establecido es a un horizonte de 1 día.

Clasificación:	Discrecional
Calificación:	
Escala homogénea	A/6S&P

El Fondo de inversión NO se encuentra en una estrategia temporal de inversión

Tenencia Indirecta en la cartera de SANHYDI:

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS CORPORATIVOS RENTA FIJA		
CANACOL ENERGY LTD CALLABLE NOTES FIXED 7.25%	1,079,773	2.398%
GRUPO CEMENTOS DE CHIHUAHUA SAB DE CV CALLABLE	1,052,838	2.338%
HIDROVIAS INTERNATIONAL FINANCE SARL CALLABLE	1,033,466	2.295%
GTL TRADE FINANCE INC CALLABLE NOTES FIXED 7.25%	1,031,189	2.290%
COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA ESP CALLABLE NOTES	1,013,285	2.250%
BBVA BANCOMER SA/TEXAS CALLABLE NOTES VARIABLE	979,728	2.176%
GRAN TIERRA ENERGY INC CALLABLE NOTES FIXED 7.75%	908,709	2.018%
CORP LINDLEY SA CALLABLE NOTES FIXED 6.75%	882,756	1.960%
CYDSA SAB DE CV CALLABLE NOTES FIXED 6.25%	848,410	1.884%
CSN RESOURCES SA CALLABLE NOTES FIXED 7.625%	843,895	1.874%
TUPY OVERSEAS SA CALLABLE BOND FIXED 6.625%	785,855	1.745%
CONTROLADORA MABE SA DE CV CALLABLE NOTES FIXED	785,627	1.745%
PATRIMONIO EN FIDEICOMISO DS 093-2002-EF-INRETAIL	779,518	1.731%
EMPRESA NACIONAL DE TELECOMUNICACIONES SA CALLABLE	775,908	1.723%
MINERVA LUXEMBOURG SA CALLABLE NOTES FIXED 6.5%	767,358	1.704%
GOL FINANCE INC CALLABLE NOTES FIXED 7%	740,841	1.645%
ATENTO LUXCO 1 SA CALLABLE NOTES FIXED 6.125%	739,520	1.642%
AJECORP BV CALLABLE NOTES FIXED 6.5% 14/MAY/2022	720,744	1.600%
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA/GRAND CAYMAN CALLABLE	710,916	1.579%
BANCO DE CREDITO DEL PERU/PANAMA CALLABLE NOTES	688,286	1.528%
VARIOS	27,864,305	61.875%
Total Tenencia Indirecta en SANHYDI:	45,032,926	100.000%

La calificación mostrada en los valores integrantes del fondo SANHYDI, corresponde a una calificación en escala internacional, mientras que la calificación del Fondo de Inversión LATAMCB, se expresa en escala nacional.