

**CARTERA MENSUAL
SAM-AP
AGOSTO 2019**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSÁTILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)			16,355,376	1.110%
1ISP	VOO	SIN BURSÁTILIDAD	16,355,376	1.110%
ACCIONES DE SI DEUDA			1,457,683,655	98.887%
51	DEUDAOP	AAA/2	294,237,189	19.961%
51	FONSER1	AAA/2	589,253,696	39.974%
51	STEREAL	AAA/6	338,438,975	22.959%
51	STERGOB	AAA/1	146,930,315	9.967%
51	ST&ER-4	AAA/2	88,823,480	6.026%
INVERSION EN DOLARES			56,477	0.004%
CHD	BSANT	2945067	56,477	0.004%
TOTAL CARTERA			1,474,095,508	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			1,472,430,620	
VAR ESTABLECIDO				0.800%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.045%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Renta Variable 13, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable

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:	Especializada en deuda
Calificación:	
Escala homogénea	NA

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

Tenencia Indirecta en la cartera de STEREAL :
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	7,124,118	2.105%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	208,046,527	61.472%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	15,275,031	4.513%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	43,060,898	12.723%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-219,359	-0.065%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	12,401,162	3.664%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	40,945,537	12.088%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	11,805,060	3.488%
Total Tenencia Indirecta en STEREAL :	338,438,975	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de DEUDAOP :
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	26,574,715	9.032%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	44,155,230	15.007%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	5,593,187	1.901%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	12,965,606	4.407%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	44,420,578	15.097%
CEDES	31,245,134	10.619%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	5,516,503	1.875%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	1,557,275	0.529%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	21,517,637	7.313%
INVERSION EN DOLARES	5,817	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	4,517	-0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-623,193	-0.212%
PRLV	32,675,749	11.105%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	3,578,001	1.216%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	40,951,931	13.918%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	23,633,077	8.032%
	475,363	0.162%
	-903	0.000%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	294,237,189	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	10,859,303	1.843%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	151,401,934	25.694%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	23,507,175	3.989%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	117,003,046	19.856%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	45,000,968	7.637%
CEDES	75,324,462	12.783%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	5,568,236	0.945%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	218,421	0.037%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL	239,430	0.041%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	12,619,909	2.142%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-392,780	-0.067%
PRLV	61,720,805	10.474%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	3,491,528	0.593%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	67,504,904	11.456%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	14,734,986	2.501%
	451,368	0.077%
Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :	589,253,696	100.000%