

**CARTERA MENSUAL
SELECTC
AGOSTO 2019**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACS EXTRANJEROS FIX				
11	FRMKNX	N SIN BURSATILIDAD	98,019,000	3.411%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				
11SP	EEM	* SIN BURSATILIDAD	32,023,127	1.115%
ACCIONES DE SI DEUDA				
51	DEUDAOP	F AAA/2	1,060,359,078	36.904%
51	FONSER1	F AAA/2	1,154,387,261	40.176%
51	STAER-7	F AAA/5	64,913,590	2.259%
CEDES				
F	HSBGMX	18012 mxA-1+	22,031,962	0.767%
PRLV				
I	BACMEXT	20045 mxA-1+	397,273,113	13.826%
I	BANSAN	20114 MX-1	145,224,450	5.054%
I	BSC7IA	19504 mxA-1+	77,354,891	2.692%
I	BSC7IA	19512 mxA-1+	32,233,542	1.122%
I	BSC7IA	19512 mxA-1+	142,460,230	4.958%
INVERSION EN DOLARES				
CHD	BSANT	2945017	1,689,393	0.059%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				
95	PEMEX	11.3 Aa3.mx	39,387,295	1.371%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				
FD	VARIOS		163,701	0.006%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				
AIM	VARIOS		3,048,102	0.106%
EAIM	VARIOS		1,728,600	0.060%
			1,319,502	0.046%
TOTAL CARTERA			2,873,295,582	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			2,858,128,206	
VAR ESTABLECIDO				1.100%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.083%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Balanceado 4, S.A. de C.V. F.I.R.L.V.

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	NA

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

Tenencia Indirecta en la cartera de DEUDAOP :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	95,768,792	9.032%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	159,124,681	15.007%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	20,156,483	1.901%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	46,724,882	4.407%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	160,080,931	15.097%
CEDES	112,599,843	10.619%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	19,880,131	1.875%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	5,612,040	0.529%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	77,544,318	7.313%
INVERSION EN DOLARES	20,962	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-16,278	-0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-2,245,837	-0.212%
PRLV	117,755,432	11.105%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	12,894,244	1.216%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	147,580,772	13.915%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	85,167,845	8.032%
	-3,255	0.000%
	1,713,093	0.162%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	1,060,359,078	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	21,274,098	1.843%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	296,606,478	25.694%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	88,159,895	7.637%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	46,052,122	3.989%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	229,216,764	19.856%
CEDES	147,565,642	12.753%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	10,908,546	0.945%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	427,901	0.037%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL	469,060	0.041%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	24,723,243	2.142%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-769,462	-0.067%
PRLV	120,915,171	10.474%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	6,840,136	0.593%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	132,246,606	11.456%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	28,866,819	2.501%
	884,261	0.077%
Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :	1,154,387,261	100.000%