

**CARTERA MENSUAL
ST&ER1P
AGOSTO 2019**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				165,752,655	15.866%
M	BONOS	211209	mxAAA	165,752,655	15.866%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				342,697,962	32.803%
IM	BPAG28	191121	mxAAA	42,698,148	4.087%
IM	BPAG28	200220	mxAAA	24,739,223	2.368%
IM	BPAG28	200514	mxAAA	28,858,766	2.762%
IM	BPAG28	201112	mxAAA	39,671,516	3.797%
IM	BPAG28	210211	mxAAA	28,830,328	2.760%
IM	VARIOS			47,227,988	4.521%
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	50,232,506	4.808%
IQ	VARIOS			34,000,839	3.255%
IS	BPA182	191010	mxAAA	44,510,145	4.260%
IS	VARIOS			1,928,502	0.185%
CEDES				132,642,500	12.696%
F	VARIOS			132,642,500	12.696%
PRLV				109,845,426	10.514%
I	NAFIN	19374	mxA-1+	25,235,679	2.416%
I	VARIOS			84,609,747	8.099%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D				293,785,635	28.121%
LD	BONDES D	191024	mxAAA	41,235,561	3.947%
LD	BONDES D	191226	mxAAA	50,077,335	4.793%
LD	BONDES D	200408	mxAAA	36,025,830	3.448%
LD	BONDES D	200625	mxAAA	51,613,764	4.940%
LD	BONDES D	200702	mxAAA	34,222,099	3.276%
LD	VARIOS			80,611,046	7.716%
TOTAL CARTERA				1,044,724,179	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,044,723,530	
VAR ESTABLECIDO					0.060%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.004%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 11, 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: Corto plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/2S&P

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