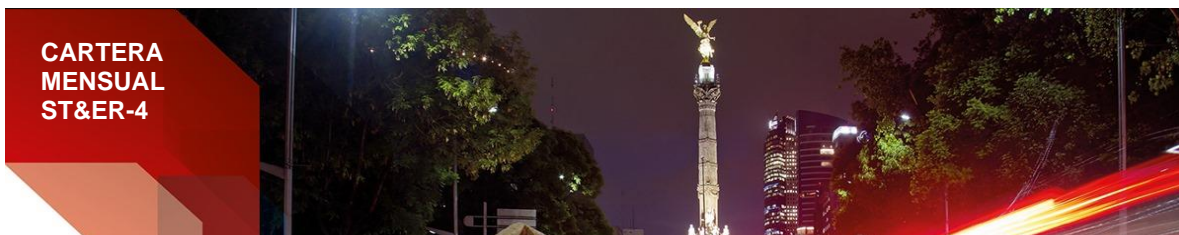


CARTERA MENSUAL
ST&ER-4
AGOSTO 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
99	BACOMER	3-18		3,886,556	0.468%
				3,886,556	0.468%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				100,538,123	12.094%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	33,512,501	4.031%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	33,512,529	4.031%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	33,513,092	4.031%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				238,449,377	28.684%
IM	BPAG28	200813	mxAAA	77,800,898	9.359%
IM	BPAG28	210211	mxAAA	50,006,293	6.015%
IM	BPAG28	210513	mxAAA	100,473,663	12.086%
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	10,168,524	1.223%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.				0	0.000%
2	ACERMEX	86		0	0.000%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				49,112,871	5.908%
91	VARIOS			49,112,871	5.908%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				4,057,664	0.488%
94	SCOTIAB	19	mxAAA	4,057,664	0.488%
CEDES				30,424,774	3.660%
F	BANSAN	19027	MX-1	30,424,774	3.660%
PRLV				81,760,450	9.835%
I	BANORTE	19452	mxA-1+	9,845,200	1.184%
I	BANSAN	20114	MX-1	47,946,650	5.768%
I	BANSAN	20115	MX-1	23,968,600	2.883%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				7,042,735	0.847%
JL	CABEI	1-19	mxAAA	7,042,735	0.847%
BONOS				205,839,537	24.761%
M	BONOS	231207	mxAAA	21,212,451	2.552%
M	BONOS	241205	mxAAA	77,792,214	9.358%
M	BONOS	270603	mxAAA	54,611,729	6.569%
M	BONOS	290531	mxAAA	23,673,606	2.848%
M	VARIOS			28,549,536	3.434%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				40,150,701	4.830%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	22,193,549	2.670%
S	VARIOS			17,957,151	2.160%
INVERSION EN DOLARES				7,565	0.001%
CHD	BSANT	2945027		7,565	0.001%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				63,815,063	7.676%
9S	PEMEX	10-2	Aa3.mx	19,133,858	2.302%
9S	PEMEX	11-3	Aa3.mx	29,540,471	3.553%
9S	VARIOS			15,140,733	1.821%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				-27,918	-0.003%
FD	VARIOS			-27,918	-0.003%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				-185,250	-0.022%
SWP	VARIOS			-185,250	-0.022%
FCSP	UXY	29		-5,008	-0.001%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				6,439,860	0.775%
AIM	VARIOS			1,431,102	0.172%
EAIM	VARIOS			5,008,758	0.603%
TOTAL CARTERA				831,307,098	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				802,468,932	
VAR ESTABLECIDO					0.246%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.142%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Deuda 3, 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: Mediano plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/SS&P

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