

CARTERA MENSUAL
ST&ER-4
MAYO 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
99	BACOMER	3-18		3,768,192	0.279%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				146,558,246	10.842%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	48,852,409	3.614%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	48,852,939	3.614%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	48,852,898	3.614%
TÍTULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS				16,049,877	1.187%
JE	AMX	0619	mxAAA	16,049,877	1.187%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				445,021,082	32.922%
IM	BPAG28	200813	mxAAA	77,642,278	5.744%
IM	BPAG28	210211	mxAAA	50,231,455	3.716%
IM	BPAG28	210513	mxAAA	230,639,140	17.062%
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	50,832,033	3.760%
IS	BPA182	210311	mxAAA	35,676,176	2.639%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.				0	0.000%
2	ACERMEX	86		0	0.000%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				56,698,774	4.194%
91	VARIOS			56,698,774	4.194%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				9,052,989	0.670%
94	VARIOS			9,052,989	0.670%
CEDES				75,351,736	5.574%
F	BANSAN	18084	MX-1	50,286,208	3.720%
F	HSBCMX	18012	mxA-1+	25,065,528	1.854%
PRLV				89,816,045	6.644%
I	BANSAN	20114	MX-1	46,828,850	3.464%
I	VARIOS			42,987,195	3.180%
BONOS				368,499,004	27.261%
M	BONOS	240905	mxAAA	56,263,283	4.162%
M	BONOS	241205	mxAAA	61,708,987	4.565%
M	BONOS	270603	mxAAA	140,922,202	10.425%
M	BONOS	290531	mxAAA	35,299,844	2.611%
M	BONOS	381118	mxAAA	43,368,623	3.208%
M	VARIOS			30,936,065	2.289%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				22,351,147	1.653%
S	VARIOS			22,351,147	1.653%
INVERSION EN DOLARES				7,416	0.001%
CHD	BSANT	2945027		7,416	0.001%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				58,032,357	4.293%
95	PEMEX	11-3	Aa3.mx	28,677,834	2.122%
95	VARIOS			29,354,523	2.172%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D				52,123,171	3.856%
LD	BONDESD	191205	mxAAA	52,123,171	3.856%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				483,384	0.036%
FD	VARIOS			483,384	0.036%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				2,334,294	0.173%
SWP	VARIOS			2,334,294	0.173%
				-154,743	-0.011%
FCSP	VARIOS			-154,743	-0.011%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				5,767,782	0.427%
AIM	VARIOS			2,072,874	0.153%
EAIM	VARIOS			3,694,908	0.273%
TOTAL CARTERA				1,351,760,753	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,340,145,453	
VAR ESTABLECIDO					0.246%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.198%

Cartera al 31/05/2019 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/3S&P

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