

CARTERA MENSUAL
ST&ER-7
AGOSTO 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
				9,148,354	0.721%
99	BACOMER	3-18		9,148,354	0.721%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				8,987,208	0.708%
LD	VARIOS			4,493,921	0.354%
S	VARIOS			4,493,287	0.354%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA				82,526,727	6.500%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	82,526,727	6.500%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				96,956,431	7.637%
91	VARIOS			96,956,431	7.637%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				9,386,340	0.739%
94	COMPART	16-2	AA+(mex)	9,386,340	0.739%
CEDES				30,424,774	2.396%
F	BANSAN	19027	MX-1	30,424,774	2.396%
BONOS				722,351,966	56.897%
M	BONOS	240905	mxAAA	49,432,410	3.894%
M	BONOS	241205	mxAAA	336,363,083	26.494%
M	BONOS	260305	mxAAA	88,122,979	6.941%
M	BONOS	270603	mxAAA	54,821,774	4.318%
M	BONOS	290531	mxAAA	119,044,421	9.377%
M	VARIOS			74,567,299	5.873%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				56,699,935	4.466%
S	VARIOS			56,699,935	4.466%
INVERSION EN DOLARES				15,590	0.001%
CHD	BSANT	2945030		15,590	0.001%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				245,440,660	19.333%
95	PEMEX	10-2	Aa3.mx	49,059,015	3.864%
95	PEMEX	11-3	Aa3.mx	157,118,875	12.376%
95	VARIOS			39,262,770	3.093%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				-68,526	-0.005%
FD	VARIOS			-68,526	-0.005%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				-4,995,790	-0.394%
SWP	VARIOS			-4,995,790	-0.394%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				-7,511	-0.001%
FCSP	UXY	Z9		-7,511	-0.001%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				12,704,466	1.001%
AIM	VARIOS			4,948,053	0.390%
EAIM	VARIOS			7,756,413	0.611%
TOTAL CARTERA				1,269,570,625	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,264,793,061	
VAR ESTABLECIDO					0.800%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.399%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Deuda 4, 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:	Largo plazo
Calificación:	
Escala homogénea	AAA/5S&P

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