

**CARTERA MENSUAL  
ST&ER-7  
DICIEMBRE 2018**



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
99	BACOMER	3-18		8,298,939	0.390%
<b>TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE</b>				<b>96,784,711</b>	<b>4.551%</b>
S	UDIBONO	190613	mxAAA	4,025,738	0.189%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	46,379,550	2.181%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	46,379,423	2.181%
<b>TÍTULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS</b>				<b>1,879,716</b>	<b>0.088%</b>
JE	AMX	0619	mxAAA	1,879,716	0.088%
<b>BONOS DE PROTECCION AL AHORRO</b>				<b>178,673,226</b>	<b>8.401%</b>
IM	BPAG28	200813	mxAAA	60,235,301	2.832%
IS	BPA182	200130	mxAAA	118,437,924	5.569%
<b>CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA</b>				<b>82,433,023</b>	<b>3.876%</b>
2U	CBIC003	210128	mxAAA	82,433,023	3.876%
<b>CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS</b>				<b>160,826,329</b>	<b>7.562%</b>
91	VARIOS			160,826,329	7.562%
<b>CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO</b>				<b>12,106,177</b>	<b>0.569%</b>
94	VARIOS			12,106,177	0.569%
<b>CEDES</b>				<b>50,142,080</b>	<b>2.358%</b>
F	BANSAN	18029	MX-1	50,142,080	2.358%
<b>BONOS</b>				<b>1,183,533,577</b>	<b>55.647%</b>
M	BONOS	211209	mxAAA	92,806,994	4.364%
M	BONOS	220609	mxAAA	127,587,675	5.999%
M	BONOS	241205	mxAAA	262,450,782	12.340%
M	BONOS	260305	mxAAA	255,502,890	12.013%
M	BONOS	270603	mxAAA	182,443,721	8.578%
M	BONOS	290531	mxAAA	54,087,246	2.543%
M	BONOS	310529	mxAAA	175,318,060	8.243%
M	VARIOS			33,336,209	1.567%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS</b>				<b>21,889,156</b>	<b>1.029%</b>
S	VARIOS			21,889,156	1.029%
<b>INVERSION EN DOLARES</b>				<b>11,338</b>	<b>0.001%</b>
CHD	BSANT	2945030		11,338	0.001%
<b>VALORES PARAESTATALES A RENDIM.</b>				<b>316,537,505</b>	<b>14.883%</b>
95	PEMEX	10-2	Aa3.mx	50,126,920	2.357%
95	PEMEX	11-3	Aa3.mx	171,753,835	8.075%
95	VARIOS			94,656,751	4.451%
<b>OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS</b>				<b>-117,537</b>	<b>-0.006%</b>
FD	DEUA	MR19		-117,537	-0.006%
<b>OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS</b>				<b>2,432,907</b>	<b>0.114%</b>
SWP	VARIOS			2,432,907	0.114%
<b>APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS</b>				<b>11,499,765</b>	<b>0.541%</b>
FCSP	UXY	H9		-73,641	-0.003%
AIM	VARIOS			5,859,156	0.275%
EAIM	VARIOS			5,640,609	0.265%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>2,126,857,270</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>				<b>2,105,630,195</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>					<b>0.800%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>					<b>0.462%</b>

Cartera al 31/12/2018 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