

CARTERA MENSUAL
STEREAL
AGOSTO 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTEO				83,047,675	12.079%
LD	BONDESD	230831	mxAAA	41,523,984	6.040%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	41,523,691	6.040%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				30,981,540	4.506%
IS	BPA182	191010	mxAAA	30,981,540	4.506%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA				87,338,150	12.703%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	65,482,856	9.525%
2U	CBIC008	231207	mxAAA	21,855,295	3.179%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				25,152,624	3.658%
JL	CABEI	1-19	mxAAA	25,152,624	3.658%
BONOS				14,449,474	2.102%
M	BONOS	240905	mxAAA	14,449,474	2.102%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				421,969,805	61.376%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	206,955,632	30.102%
S	UDIBONO	251204	mxAAA	161,328,139	23.465%
S	UDIBONO	281130	mxAAA	27,820,140	4.046%
S	UDIBONO	501103	mxAAA	25,865,893	3.762%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				23,943,581	3.483%
95	VARIOS			23,943,581	3.483%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				-444,914	-0.065%
SWP	VARIOS			-444,914	-0.065%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				1,077,186	0.157%
AIM	VARIOS			464,000	0.067%
EAIM	VARIOS			613,186	0.089%
TOTAL CARTERA				687,515,121	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				706,559,561	
VAR ESTABLECIDO					0.800%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.250%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Deuda 6, 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: Discrecional

Calificación:

Escala homogénea AAA/4S&P

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