

CARTERA MENSUAL  
STEREAL  
MAYO 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
<b>TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE</b>				<b>56,200,400</b>	<b>13.128%</b>
LD	BONDESD	230504	mxAAA	28,100,195	6.564%
M	BONOS	270603	mxAAA	28,100,205	6.564%
<b>BONOS DE PROTECCION AL AHORRO</b>				<b>31,045,205</b>	<b>7.252%</b>
IS	BPA182	200130	mxAAA	31,045,205	7.252%
<b>CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA</b>				<b>87,408,224</b>	<b>20.418%</b>
2U	CBIC003	210128	mxAAA	65,773,128	15.364%
2U	CBIC008	231207	mxAAA	21,635,096	5.054%
<b>BONOS</b>				<b>13,605,485</b>	<b>3.178%</b>
M	BONOS	240905	mxAAA	13,605,485	3.178%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS</b>				<b>225,225,602</b>	<b>52.610%</b>
S	UDIBONO	220609	mxAAA	114,947,932	26.851%
S	UDIBONO	251204	mxAAA	57,654,657	13.467%
S	UDIBONO	281130	mxAAA	32,042,921	7.485%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	15,814,950	3.694%
S	UDIBONO	461108	mxAAA	4,765,142	1.113%
<b>VALORES PARAESTATALES A RENDIM.</b>				<b>13,528,659</b>	<b>3.160%</b>
95	VARIOS			13,528,659	3.160%
<b>OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS</b>				<b>70,702</b>	<b>0.017%</b>
SWP	VARIOS			70,702	0.017%
<b>APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS</b>				<b>1,018,958</b>	<b>0.238%</b>
AIM	VARIOS			512,000	0.120%
EAIM	VARIOS			506,958	0.118%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>428,103,234</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>				<b>397,958,225</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>					<b>0.800%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>					<b>0.261%</b>

Cartera al 31/05/2019 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: Largo plazo tasa real

Calificación:

Escala homogénea AAA/4S&P

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