

**CARTERA MENSUAL
ST&ERUS
AGOSTO 2019**



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTEO				607,876	1.726%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	607,876	1.726%
UMS (SPOT)				31,234,341	88.692%
D1SP	MEXD97	210121	BBB	12,335,190	35.026%
D1SP	UMS22F2	2022F	BBB	18,899,151	53.665%
INVERSION EN DOLARES				3,374,568	9.582%
CHD	BSANT	2945034		3,330,827	9.458%
CHD	JPMOR	3584034		43,741	0.124%
TOTAL CARTERA				35,216,785	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				35,173,037	
VAR ESTABLECIDO					3.005%
VAR OBSERVADO (Promedio)					1.274%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Deuda 11, 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 en moneda extranjera

Calificación:

Escala homogénea AAA/6S&P

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