

CARTERA SEMANAL
LATAMCB
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE		2,475,866	5.243%
2U	CBIC002 300117 mxAAA	2,475,866	5.243%
SOCIEDADES DE INVERSIÓN EXTRANJERAS (SPOT)		44,106,242	93.395%
56SP	SANHYDI LX NA	44,106,242	93.395%
INVERSIÓN EN DOLARES		643,392	1.362%
CHD	BSANT 2945007	643,392	1.362%
TOTAL CARTERA		47,225,500	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		47,297,055	
VAR ESTABLECIDO			2.700%
VAR OBSERVADO (Promedio)			1.323%

Cartera al 12/09/2019 FONDO SAM DEUDA 5, 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.

Categoría:	Discrecional
Calificación:	
Escala homogénea	A/6S&P

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

Tenencia Indirecta en la cartera de SANHYDI:
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS CORPORATIVOS RENTA FIJA		
CANACOL ENERGY LTD CALLABLE NOTES FIXED 7.25%	1,084,504	2.459%
GRUPO CEMENTOS DE CHIHUAHUA SAB DE CV CALLABLE	1,054,400	2.391%
HIDROVIAS INTERNATIONAL FINANCE SARL CALLABLE	1,039,003	2.356%
GTL TRADE FINANCE INC CALLABLE NOTES FIXED 7.25%	1,037,331	2.352%
COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA ESP CALLABLE NOTES	1,013,412	2.298%
BBVA BANCOMER SA/TEXAS CALLABLE NOTES VARIABLE	975,959	2.213%
GRAN TIERRA ENERGY INC CALLABLE NOTES FIXED 7.75%	904,052	2.050%
CORP LINDLEY SA CALLABLE NOTES FIXED 6.75%	884,436	2.005%
CSN RESOURCES SA CALLABLE NOTES FIXED 7.625%	873,534	1.981%
CYDSA SAB DE CV CALLABLE NOTES FIXED 6.25%	855,095	1.939%
CONTROLADORA MABE SA DE CV CALLABLE NOTES FIXED	793,528	1.799%
TUPY OVERSEAS SA CALLABLE BOND FIXED 6.625%	789,640	1.790%
PATRIMONIO EN FIDEICOMISO DS 093-2002-EF-INRETAIL	779,839	1.768%
EMPRESA NACIONAL DE TELECOMUNICACIONES SA CALLABLE	774,158	1.755%
MINERVA LUXEMBOURG SA CALLABLE NOTES FIXED 6.5%	773,270	1.753%
GOL FINANCE INC CALLABLE NOTES FIXED 7%	751,807	1.705%
AJECORP BV CALLABLE NOTES FIXED 6.5% 14/MAY/2022	740,442	1.679%
ATENTO LUXCO 1 SA CALLABLE NOTES FIXED 6.125%	736,893	1.671%
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA/GRAND CAYMAN CALLABLE	722,852	1.639%
GENNEIA SA CALLABLE NOTES FIXED 8.75% 20/JAN/2022	699,221	1.585%
VARIOS	26,822,866	60.814%
Total Tenencia Indirecta en SANHYDI:	44,106,242	100.000%

La calificación mostrada en los valores integrantes del fondo SANHYDI, corresponde a una calificación en escala internacional, mientras que la calificación del Fondo de Inversión LATAMCB, se expresa en escala nacional.