

CARTERA SEMANAL
SAM-AP
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				16,327,905	1.108%
1ISP	VOO	*	SIN BURSATILIDAD	16,327,905	1.108%
ACCIONES DE SI DEUDA				1,457,004,696	98.888%
51	DEUDAOP	F	AAA/2	294,554,280	19.992%
51	FONSER1	F	AAA/2	588,754,762	39.959%
51	STEREAL	F	AAA/6	337,733,910	22.922%
51	STERGOB	F	AAA/1	147,245,574	9.994%
51	ST&ER-4	F	AAA/2	88,716,170	6.021%
INVERSION EN DOLARES				54,747	0.004%
CHD	BSANT	2945067		54,747	0.004%
TOTAL CARTERA				1,473,387,348	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,451,117,201	
VAR ESTABLECIDO					0.800%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.055%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Renta Variable 13, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable

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:	Especializada en deuda
Calificación:	
Escala homogénea	NA

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

Tenencia Indirecta en la cartera de STERREAL :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	7,508,784	2.223%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	151,708,535	44.920%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	16,813,794	4.978%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	84,483,561	25.015%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-243,473	-0.072%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	13,681,067	4.051%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	51,079,398	15.124%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	12,702,245	3.761%
Total Tenencia Indirecta en STERREAL :	337,733,910	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de DEUDAOP :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	25,492,211	8.655%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	41,740,475	14.171%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	4,039,502	1.371%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	43,128,105	14.642%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	12,631,925	4.288%
CEDES	32,266,790	10.954%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	5,363,756	1.821%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	746,236	0.253%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	20,839,979	7.075%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	2,177,008	0.739%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	6,831,591	2.319%
INVERSION EN DOLARES	5,480	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-575	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-612,544	-0.208%
PRLV	31,838,195	10.809%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	3,489,196	1.185%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	39,656,115	13.463%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	24,462,606	8.305%
	-4,999	-0.002%
	463,227	0.157%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	294,554,280	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	14,067,204	2.389%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	140,494,898	23.863%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	23,548,714	4.000%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	45,083,470	7.657%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	116,493,170	19.786%
CEDES	72,355,576	12.290%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	5,557,290	0.944%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	218,828	0.037%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL	239,884	0.041%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	12,594,282	2.139%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	10,772,021	1.830%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-406,545	-0.069%
PRLV	51,500,738	8.747%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	3,497,168	0.594%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	77,542,454	13.171%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	14,743,332	2.504%
	452,277	0.077%
Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :	588,754,762	100.000%