

**CARTERA SEMANAL
SELECTC**
19 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACS EXTRANJEROS FIX			98,514,000	3.483%
11	FRMKNX	N SIN BURSATILIDAD	98,514,000	3.483%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)			32,140,100	1.136%
11SP	EEM	* SIN BURSATILIDAD	32,140,100	1.136%
ACCIONES DE SI DEUDA			2,221,569,340	78.539%
51	DEUDAOP	F AAA/2	1,063,606,018	37.602%
51	FONSER1	F AAA/2	1,092,870,846	38.636%
51	STAER-7	F AAA/5	65,092,476	2.301%
CEDES			21,977,040	0.777%
F	HSBICMX	18012 mxA-1+	21,977,040	0.777%
PRLV			398,908,447	14.103%
I	BACMEXT	20045 mxA-1+	145,821,600	5.155%
I	BANSAN	20114 MX-1	77,670,221	2.746%
I	BSC7IA	19504 mxA-1+	32,366,994	1.144%
I	BSC7IA	19512 mxA-1+	143,049,632	5.057%
INVERSION EN DOLARES			84,477	0.003%
CHD	BSANT	2945017	84,477	0.003%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.			51,830,766	1.832%
95	VARIOS		51,830,766	1.832%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			3,590,100	0.127%
EAIM	BANSAN	0012776	3,590,100	0.127%
TOTAL CARTERA			2,828,614,270	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			2,818,302,790	
VAR ESTABLECIDO				1.100%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.083%

Cartera al 19/09/2019 Fondo SAM Balanceado 4, S.A. de C.V. F.I.R.V.

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: NA

Escala homogénea: NA

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

Tenencia Indirecta en la cartera de DEUDAOP :
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	96,474,610	8.130%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	152,775,764	14.264%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	14,132,587	1.329%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	62,109,231	5.839%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	153,773,873	14.458%
CEDES	123,371,409	11.599%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	18,794,937	1.767%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	163,838	0.015%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	74,307,997	6.986%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	7,770,019	0.731%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	24,355,429	2.290%
INVERSION EN DOLARES	19,530	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	13,098	0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-2,775,138	-0.261%
PRLV	105,188,461	9.890%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	16,610,208	1.562%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	137,892,170	12.965%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	86,980,860	8.178%
	1,647,134	0.155%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	1,063,606,018	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	25,048,123	2.292%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	262,182,456	23.999%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	217,806,857	19.330%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	44,087,477	4.034%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	88,515,251	8.099%
CEDES	138,643,734	12.686%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	10,178,898	0.931%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	37,887	0.003%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL	440,992	0.040%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	23,128,772	2.116%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	24,185,838	2.213%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-896,876	-0.082%
PRLV	85,018,548	7.779%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	7,191,639	0.659%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	139,342,503	12.759%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	27,129,588	2.482%
	829,160	0.076%
Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :	1,092,870,846	100.000%