

CARTERA SEMANAL
SMALTA2
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				3,018,212	0.319%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	3,018,212	0.319%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				931,336,368	98.512%
1ISP	EEM	*	SIN BURSATILIDAD	101,486,620	10.735%
1ISP	EPP	*	SIN BURSATILIDAD	45,007,158	4.761%
1ISP	EWJ	*	SIN BURSATILIDAD	68,455,471	7.241%
1ISP	EWU	*	SIN BURSATILIDAD	7,586,160	0.802%
1ISP	FEZ	*	SIN BURSATILIDAD	53,555,805	5.665%
1ISP	IEV	*	SIN BURSATILIDAD	81,087,776	8.577%
1ISP	ITOT	*	SIN BURSATILIDAD	36,918,574	3.905%
1ISP	SPY	*	SIN BURSATILIDAD	116,929,400	12.368%
1ISP	USMV	*	SIN BURSATILIDAD	143,203,455	15.147%
1ISP	VGK	*	SIN BURSATILIDAD	62,702,672	6.632%
1ISP	VOO	*	SIN BURSATILIDAD	172,243,286	18.219%
1ISP	VTI	*	SIN BURSATILIDAD	42,159,991	4.459%
INVERSION EN DOLARES				11,050,517	1.169%
CHD	BSANT	2945021		11,050,517	1.169%
TOTAL CARTERA				945,405,096	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				945,521,609	
VAR ESTABLECIDO					2.540%
VAR OBSERVADO (Promedio)					1.777%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Renta Variable 15, 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 acciones internacionales

Calificación:

Escala homogénea NA

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