

**CARTERA SEMANAL
STER10P**
19 SEPTIEMBRE 2019



| INSTRUMENTO | | CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD | VALOR MERCADO | % |
|--|---------|--------------------------------|----------------------|-----------------|
| 99 | BACOMER | 3-18 | 4,821,822 | 0.102% |
| | | | 4,821,822 | 0.102% |
| TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE | | | 407,376,805 | 8.590% |
| LD | BONDES | 221110 | 50,011,086 | 1.055% |
| M | BONOS | 290531 | 357,365,719 | 7.535% |
| BONOS DE PROTECCION AL AHORRO | | | 1,718,027,048 | 36.225% |
| IM | BPAG28 | 191121 | 229,201,803 | 4.833% |
| IM | BPAG28 | 200220 | 111,774,864 | 2.357% |
| IM | BPAG28 | 200514 | 147,977,972 | 3.120% |
| IM | BPAG28 | 200813 | 109,459,426 | 2.308% |
| IM | BPAG28 | 201112 | 198,825,434 | 4.192% |
| IM | BPAG28 | 210211 | 139,376,485 | 2.939% |
| IM | VARIOS | | 109,006,485 | 2.298% |
| IQ | BPAG91 | 191219 | 234,057,222 | 4.935% |
| IQ | VARIOS | | 199,794,084 | 4.213% |
| IS | BPA182 | 191010 | 228,603,995 | 4.820% |
| IS | VARIOS | | 9,949,277 | 0.210% |
| CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS | | | 92,627,591 | 1.953% |
| 91 | VARIOS | | 92,627,591 | 1.953% |
| CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL | | | 2,211,251 | 0.047% |
| 92 | FEFA | 01019 | 2,211,251 | 0.047% |
| CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL | | | 186,569 | 0.004% |
| 93 | VWLEASE | 05919 | 186,569 | 0.004% |
| CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO | | | 45,053,622 | 0.950% |
| 94 | VARIOS | | 45,053,622 | 0.950% |
| CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES) | | | 105,550,010 | 2.226% |
| BI | VARIOS | | 105,550,010 | 2.226% |
| CEDES | | | 626,887,391 | 13.218% |
| F | VARIOS | | 626,887,391 | 13.218% |
| PRLV | | | 390,433,333 | 8.232% |
| I | VARIOS | | 390,433,333 | 8.232% |
| TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES | | | 2,734,644 | 0.058% |
| JL | CABEI | 1-17 | 2,734,644 | 0.058% |
| BONOS | | | 121,725,881 | 2.567% |
| M | VARIOS | | 121,725,881 | 2.567% |
| VALORES PARAESTATALES A RENDIM. | | | 119,256,463 | 2.515% |
| 95 | VARIOS | | 119,256,463 | 2.515% |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D | | | 1,101,155,253 | 23.218% |
| LD | BONDES | 191024 | 168,524,286 | 3.533% |
| LD | BONDES | 191226 | 126,149,964 | 2.660% |
| LD | BONDES | 200408 | 185,580,956 | 3.913% |
| LD | BONDES | 200625 | 283,588,772 | 5.980% |
| LD | VARIOS | | 337,311,275 | 7.112% |
| OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS | | | -4,518,762 | -0.095% |
| SWP | VARIOS | | -4,518,762 | -0.095% |
| APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS | | | 9,069,162 | 0.191% |
| AIM | VARIOS | | 4,834,540 | 0.102% |
| EAIM | VARIOS | | 4,234,622 | 0.089% |
| TOTAL CARTERA | | | 4,742,598,082 | 100.000% |
| VALOR DEL ACTIVO NETO | | | 4,712,547,801 | |
| VAR ESTABLECIDO | | | | 0.060% |
| VAR OBSERVADO (Promedio) | | | | 0.018% |

Cartera al 19/09/2019 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 16, 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: Corto plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/2S&P

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