

**CARTERA SEMANAL
ST&ER1G**
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				10,714,257,312	100.000%
BI	CETES	200213	mxA-1+	10,541,191	0.098%
IQ	BPAG91	200423	mxAAA	533,961,793	4.984%
IQ	BPAG91	210826	mxAAA	601,289,268	5.612%
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	434,961,431	4.060%
LD	BONDESD	240627	mxAAA	1,570,212,072	14.655%
M	BONOS	211209	mxAAA	1,570,212,897	14.655%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	1,570,172,688	14.655%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	1,570,172,688	14.655%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	441,012,811	4.116%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	1,411,522,021	13.174%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	1,000,198,452	9.335%
TOTAL CARTERA				10,714,257,312	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				10,705,468,254	
VAR ESTABLECIDO					0.020%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.000%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 10, 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 - gubernamental
Calificación:	
Escala homogénea	AAA/1S&P

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