

CARTERA SEMANAL
ST&ER-4
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
99	BACOMER	3-18		3,896,964	0.436%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				87,635,190	9.806%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	29,211,787	3.269%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	28,734,979	3.215%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	29,688,424	3.322%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				237,894,226	26.618%
IM	BPAG28	200813	mxAAA	77,488,908	8.670%
IM	BPAG28	210211	mxAAA	50,128,247	5.609%
IM	BPAG28	210513	mxAAA	100,083,342	11.198%
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	10,193,730	1.141%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.				0	0.000%
2	ACERMEX	86		0	0.000%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA				9,803,919	1.097%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	9,803,919	1.097%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				48,881,676	5.469%
91	VARIOS			48,881,676	5.469%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				4,071,494	0.456%
94	SCOTIAB	19	mxAAA	4,071,494	0.456%
CEDES				30,502,126	3.413%
F	BANSAN	19027	MX-1	30,502,126	3.413%
PRLV				81,972,515	9.172%
I	BANORTE	19452	mxA-1+	9,870,740	1.104%
I	BANSAN	20114	MX-1	48,071,000	5.379%
I	BANSAN	20115	MX-1	24,030,775	2.689%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				7,075,648	0.792%
JL	CABEI	1-19	mxAAA	7,075,648	0.792%
BONOS				285,988,909	31.999%
M	BONOS	220609	mxAAA	120,618,278	13.496%
M	BONOS	231207	mxAAA	21,173,555	2.369%
M	BONOS	241205	mxAAA	54,416,270	6.089%
M	BONOS	270603	mxAAA	22,887,120	2.561%
M	BONOS	290531	mxAAA	35,659,918	3.990%
M	VARIOS			31,233,767	3.495%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				26,248,154	2.937%
S	VARIOS			26,248,154	2.937%
INVERSION EN DOLARES				7,333	0.001%
CHD	BSANT	2945027		7,333	0.001%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				63,831,738	7.142%
95	PEMEX	10-2	Aa3.mx	19,198,258	2.148%
95	PEMEX	11-3	Aa3.mx	29,563,107	3.308%
95	VARIOS			15,070,372	1.686%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				-3,234	0.000%
FD	DEUA	DC19		-3,234	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				-163,317	-0.018%
SWP	VARIOS			-163,317	-0.018%
				-28,515	-0.003%
FCSP	VARIOS			-28,515	-0.003%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				6,114,832	0.684%
AIM	VARIOS			1,859,092	0.208%
EAIM	VARIOS			4,255,740	0.476%
TOTAL CARTERA				893,729,658	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				832,761,434	
VAR ESTABLECIDO					0.246%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.187%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Deuda 3, 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: Mediano plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/3S&P

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