

**CARTERA SEMANAL
ST&ER-7**
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
99	BACOMER	3-18		9,172,854	0.716%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO				62,945,749	4.914%
LD	BONDESD	230706	mxAAA	31,473,044	2.457%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	31,472,706	2.457%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA				107,195,578	8.368%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	82,685,781	6.454%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	24,509,797	1.913%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				96,346,326	7.521%
91	VARIOS			96,346,326	7.521%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				9,375,617	0.732%
94	COMPART	16-2	AA+(mex)	9,375,617	0.732%
CEDES				30,502,126	2.381%
F	BANSAN	19027	MX-1	30,502,126	2.381%
BONOS				664,278,175	51.854%
M	BONOS	240905	mxAAA	47,447,966	3.704%
M	BONOS	241205	mxAAA	300,677,679	23.471%
M	BONOS	260305	mxAAA	84,973,450	6.633%
M	BONOS	270603	mxAAA	54,304,893	4.239%
M	BONOS	290531	mxAAA	95,390,282	7.446%
M	BONOS	381118	mxAAA	31,368,803	2.449%
M	VARIOS			50,115,102	3.912%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				48,574,464	3.792%
S	VARIOS			48,574,464	3.792%
INVERSION EN DOLARES				15,112	0.001%
CHD	BSANT	2945030		15,112	0.001%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				245,647,029	19.175%
95	PEMEX	10-2	Aa3.mx	49,224,136	3.842%
95	PEMEX	11-3	Aa3.mx	157,239,268	12.274%
95	VARIOS			39,183,625	3.059%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				-6,732	-0.001%
FD	DEUA	DC19		-6,732	-0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				-5,019,979	-0.392%
SWP	VARIOS			-5,019,979	-0.392%
				-42,773	-0.003%
FCSP	VARIOS			-42,773	-0.003%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				12,076,882	0.943%
AIM	VARIOS			5,647,037	0.441%
EAIM	VARIOS			6,429,844	0.502%
TOTAL CARTERA				1,281,060,429	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,255,501,232	
VAR ESTABLECIDO					0.800%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.392%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Deuda 4, 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: Largo plazo

Calificación:

Escala homogénea: AAA/5S&P

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