

**CARTERA SEMANAL**  
ST&ER-7  
10 ENERO 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
99	BACOMER	3-18		8,400,263	0.433%
<b>TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE</b>				<b>157,473,074</b>	<b>8.122%</b>
2U	CBIC002	300117	mxAAA	78,736,526	4.061%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	78,736,548	4.061%
<b>TÍTULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS</b>				<b>1,884,100</b>	<b>0.097%</b>
JE	AMX	0619	mxAAA	1,884,100	0.097%
<b>BONOS DE PROTECCION AL AHORRO</b>				<b>15,113,847</b>	<b>0.780%</b>
IS	BPA182	200130	mxAAA	15,113,847	0.780%
<b>CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA</b>				<b>82,177,600</b>	<b>4.238%</b>
2U	CBIC003	210128	mxAAA	82,177,600	4.238%
<b>CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS</b>				<b>161,029,036</b>	<b>8.305%</b>
91	VARIOS			161,029,036	8.305%
<b>CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO</b>				<b>12,147,771</b>	<b>0.627%</b>
94	VARIOS			12,147,771	0.627%
<b>PRLV</b>				<b>14,401,770</b>	<b>0.743%</b>
I	BACMEXT	19255	mxA-1+	14,401,770	0.743%
<b>BONOS</b>				<b>1,151,824,615</b>	<b>59.407%</b>
M	BONOS	211209	mxAAA	93,089,432	4.801%
M	BONOS	220609	mxAAA	127,991,129	6.601%
M	BONOS	241205	mxAAA	317,892,813	16.396%
M	BONOS	260305	mxAAA	257,407,420	13.276%
M	BONOS	270603	mxAAA	183,075,693	9.442%
M	BONOS	290531	mxAAA	70,482,691	3.635%
M	BONOS	310529	mxAAA	91,318,918	4.710%
M	VARIOS			10,566,519	0.545%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS</b>				<b>21,332,567</b>	<b>1.100%</b>
S	VARIOS			21,332,567	1.100%
<b>INVERSION EN DOLARES</b>				<b>14,881</b>	<b>0.001%</b>
CHD	BSANT	2945030		14,881	0.001%
<b>VALORES PARAESTATALES A RENDIM.</b>				<b>300,505,734</b>	<b>15.499%</b>
95	PEMEX	10-2	Aa3.mx	50,265,918	2.593%
95	PEMEX	11-3	Aa3.mx	170,478,667	8.793%
95	VARIOS			79,761,149	4.114%
<b>OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS</b>				<b>-158,839</b>	<b>-0.008%</b>
FD	DEUA	MR19		-158,839	-0.008%
<b>OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS</b>				<b>2,000,111</b>	<b>0.103%</b>
SWP	VARIOS			2,000,111	0.103%
<b>APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS</b>				<b>10,714,252</b>	<b>0.553%</b>
AIM	VARIOS			5,558,800	0.287%
EAIM	VARIOS			5,155,452	0.266%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>1,938,860,780</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>				<b>1,999,018,069</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>					<b>0.800%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>					<b>0.432%</b>

Cartera al 10/01/2019 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.

Clasificación: Largo plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/5S&P

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