

**CARTERA SEMANAL
STERGOB**
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO				16,707,868,003	29.037%
BI	VARIOS			178,170,962	0.310%
IQ	BPAG91	220428	mxAAA	1,392,022,033	2.419%
LD	BONDES	220203	mxAAA	1,581,055,012	2.748%
LD	BONDES	230706	mxAAA	1,423,867,414	2.475%
LD	BONDES	240229	mxAAA	1,642,259,909	2.854%
LD	BONDES	240627	mxAAA	2,525,967,719	4.390%
LD	VARIOS			2,812,990,838	4.889%
M	BONOS	211209	mxAAA	3,192,387,627	5.548%
M	VARIOS			1,700,380,099	2.955%
S	VARIOS			258,766,390	0.450%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				18,582,399,152	32.294%
IM	BPAG28	191121	mxAAA	2,245,170,333	3.902%
IM	BPAG28	200220	mxAAA	1,372,229,655	2.385%
IM	BPAG28	200514	mxAAA	1,892,913,446	3.290%
IM	BPAG28	201112	mxAAA	2,280,334,766	3.963%
IM	BPAG28	210211	mxAAA	1,586,759,515	2.758%
IM	VARIOS			2,478,890,164	4.308%
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	3,249,659,027	5.648%
IQ	VARIOS			1,781,969,058	3.097%
IS	BPA182	191010	mxAAA	1,633,059,629	2.838%
IS	VARIOS			61,413,558	0.107%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				2,116,082,817	3.678%
BI	VARIOS			2,116,082,817	3.678%
BONOS				593,612,128	1.032%
M	BONOS	191211	mxAAA	593,612,128	1.032%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D				19,540,933,952	33.960%
LD	BONDES	191024	mxAAA	1,734,796,772	3.015%
LD	BONDES	191226	mxAAA	4,160,003,778	7.230%
LD	BONDES	200130	mxAAA	2,030,090,639	3.528%
LD	BONDES	200408	mxAAA	1,983,525,359	3.447%
LD	BONDES	200625	mxAAA	3,180,545,347	5.527%
LD	BONDES	200702	mxAAA	2,260,015,391	3.928%
LD	VARIOS			4,191,956,667	7.285%
TOTAL CARTERA				57,540,896,052	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				57,502,876,586	
VAR ESTABLECIDO					0.015%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.002%

Cartera al 12/09/2019 FONDO SAM DEUDA CORTO PLAZO 6, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION 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