

CARTERA SEMANAL
ST&ER-I
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				626,581	0.285%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	626,581	0.285%
PRESTAMO DE VALORES				700,280	0.319%
1	GFINBUR	O	ALTA	700,280	0.319%
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES				29,711,515	13.527%
1	AMX	L	ALTA	24,243,907	11.038%
1	VARIOS			5,467,608	2.489%
SERVICIOS FINANCIEROS				61,860,008	28.164%
1	GFNORTE	O	ALTA	25,268,967	11.505%
1	VARIOS			5,701,825	2.596%
1B	NAFRAC	ISHRS	ALTA	25,650,000	11.678%
41	VARIOS			5,239,217	2.385%
SALUD				180,137	0.082%
1	LAB	B	ALTA	180,137	0.082%
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE				64,169,392	29.216%
1	FEMSA	UBD	ALTA	24,874,325	11.325%
1	VARIOS			16,851,144	7.672%
1	WALMEX	*	ALTA	22,443,923	10.219%
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				10,667,740	4.857%
1	ELEKTRA	*	ALTA	6,312,158	2.874%
1	VARIOS			4,355,581	1.983%
INDUSTRIAL				22,274,816	10.142%
1	ASUR	B	ALTA	5,035,081	2.292%
1	GAP	B	ALTA	5,689,768	2.591%
1	VARIOS			11,549,967	5.259%
MATERIALES				26,254,782	11.954%
1	CEMEX	CPO	ALTA	8,296,203	3.777%
1	GMEXICO	B	ALTA	10,892,010	4.959%
1	VARIOS			7,066,569	3.217%
ENERGIA				3,193,391	1.454%
1	IENOVA	*	ALTA	3,193,391	1.454%
TOTAL CARTERA				219,638,642	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				219,666,514	
VAR ESTABLECIDO					2.500%
VAR OBSERVADO (Promedio)					2.053%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Renta Variable 23, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable

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: Especializada en acciones indizadas nacionales

Calificación:

Escala homogénea NA

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