

**CARTERA SEMANAL
ST&ERUS**
19 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%	
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			604,154	1.769%	
2U	CBIC004	310116	mxAAA	604,154	1.769%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)			9,868,242	28.888%	
1ISP	AFLT	N	SIN BURSATILIDAD	4,072,249	11.921%
1ISP	IBTA	N	SIN BURSATILIDAD	4,046,437	11.846%
1ISP	VTIP	*	SIN BURSATILIDAD	1,749,556	5.122%
UMS (SPOT)			18,036,729	52.801%	
D1SP	UMS22F2	2022F	BBB	18,036,729	52.801%
INVERSION EN DOLARES			5,650,723	16.542%	
CHD	BSANT	2945034		5,608,266	16.418%
CHD	JPMOR	3584034		42,456	0.124%
TOTAL CARTERA			34,159,848	100.000%	
VALOR DEL ACTIVO NETO			34,150,300		
VAR ESTABLECIDO				3.005%	
VAR OBSERVADO (Promedio)				1.246%	

Cartera al 19/09/2019 Fondo SAM Deuda 11, 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 en moneda extranjera

Calificación:

Escala homogénea AAA/6S&P

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