

CARTERA SEMANAL
STRGOB2
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				1,512,080,926	37.415%
LD	BONDES	230706	mxAAA	306,264,357	7.578%
M	BONOS	260305	mxAAA	655,693,742	16.225%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	550,122,827	13.612%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				1,316,527,201	32.576%
IM	BPAG28	191121	mxAAA	280,909,644	6.951%
IM	BPAG28	200220	mxAAA	100,177,373	2.479%
IM	BPAG28	200514	mxAAA	253,510,972	6.273%
IM	BPAG28	200813	mxAAA	99,985,688	2.474%
IM	BPAG28	210211	mxAAA	100,256,493	2.481%
IM	BPAG28	210513	mxAAA	150,125,013	3.715%
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	254,843,238	6.306%
IQ	VARIOS			60,983,979	1.509%
IS	VARIOS			15,734,800	0.389%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				194,847,040	4.821%
BI	CETES	191205	mxA-1+	98,253,460	2.431%
BI	CETES	200227	mxA-1+	96,593,580	2.390%
BONOS				34,361,691	0.850%
M	VARIOS			34,361,691	0.850%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				8,655,665	0.214%
S	VARIOS			8,655,665	0.214%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D				974,905,438	24.123%
LD	BONDES	191024	mxAAA	200,669,374	4.965%
LD	BONDES	200116	mxAAA	90,472,482	2.239%
LD	BONDES	200402	mxAAA	83,178,817	2.058%
LD	BONDES	200408	mxAAA	218,599,302	5.409%
LD	BONDES	210121	mxAAA	100,111,534	2.477%
LD	VARIOS			281,873,930	6.975%
TOTAL CARTERA				4,041,377,961	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				4,042,459,744	
VAR ESTABLECIDO					0.100%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.007%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 7, 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: Corto plazo - gubernamental

Calificación:

Escala homogénea AAA/2S&P

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