

**CARTERA SEMANAL
SUPER**
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
			20,832,660	0.069%
99	BACOMER	3-18	20,832,660	0.069%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			4,452,355,919	14.709%
LD	BONDESD	230706 mxAAA	950,212,395	3.139%
M	VARIOS		577,527,258	1.908%
S	VARIOS		128,736,996	0.425%
2U	CBIC002	300117 mxAAA	1,617,949,977	5.345%
2U	VARIOS		1,177,929,293	3.891%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO			9,059,745,098	29.930%
IM	BPAG28	191121 mxAAA	1,073,175,166	3.545%
IM	BPAG28	200220 mxAAA	630,616,563	2.083%
IM	BPAG28	200514 mxAAA	811,134,146	2.680%
IM	BPAG28	201112 mxAAA	1,058,016,681	3.495%
IM	BPAG28	210211 mxAAA	751,221,902	2.482%
IM	VARIOS		1,340,491,529	4.428%
IQ	BPAG91	191219 mxAAA	1,342,718,050	4.436%
IQ	VARIOS		929,172,655	3.070%
IS	BPA182	191010 mxAAA	1,080,459,166	3.569%
IS	VARIOS		42,739,240	0.141%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS			510,795,819	1.687%
91	VARIOS		510,795,819	1.687%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL			11,841,303	0.039%
92	FEFA	01019 mxA-1+	11,841,303	0.039%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL			11,206,832	0.037%
93	VARIOS		11,206,832	0.037%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO			231,318,106	0.764%
94	VARIOS		231,318,106	0.764%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)			554,288,181	1.831%
BI	VARIOS		554,288,181	1.831%
CEDES			3,644,318,991	12.039%
F	VARIOS		3,644,318,991	12.039%
PRLV			2,718,895,368	8.982%
I	VARIOS		2,718,895,368	8.982%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES			148,415,634	0.490%
J1	VARIOS		148,415,634	0.490%
BONOS			688,432,219	2.274%
M	VARIOS		688,432,219	2.274%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.			597,010,590	1.972%
95	VARIOS		597,010,590	1.972%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D			7,592,523,274	25.083%
LD	BONDESD	191024 mxAAA	975,955,500	3.224%
LD	BONDESD	191226 mxAAA	1,621,080,337	5.355%
LD	BONDESD	200408 mxAAA	989,956,921	3.270%
LD	BONDESD	200625 mxAAA	1,685,011,894	5.567%
LD	VARIOS		2,320,518,621	7.666%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS			-19,601,998	-0.065%
SWP	VARIOS		-19,601,998	-0.065%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			47,627,039	0.157%
AIM	VARIOS		24,874,550	0.082%
EAIM	VARIOS		22,752,489	0.075%
TOTAL CARTERA			30,270,005,035	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			30,414,038,782	
VAR ESTABLECIDO				0.170%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.015%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 17, 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
Calificación:
Escala homogénea: AAA/2S&P

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