

CARTERA SEMANAL
STERUSD
29 JULIO 2021



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				8,171,235,907	99.353%
1ISP	AFLT	N	MEDIA	900,942,660	10.954%
1ISP	BIL	*	ALTA	725,725,403	8.824%
1ISP	FLOA	N	ALTA	239,430,096	2.911%
1ISP	IBTA	N	ALTA	1,219,682,137	14.830%
1ISP	IB01	N	ALTA	815,216,863	9.912%
1ISP	JU13	N	MEDIA	1,088,633,588	13.237%
1ISP	SDIA	N	ALTA	838,379,123	10.194%
1ISP	UBBB	N	MEDIA	167,369,504	2.035%
1ISP	UCRP	N	SIN BURSATILIDAD	563,359,424	6.850%
1ISP	USMV	*	ALTA	63,000,719	0.766%
1ISP	VDCA	N	ALTA	608,087,984	7.394%
1ISP	VTIP	*	ALTA	941,408,405	11.446%
INVERSION EN DOLARES				53,241,094	0.647%
CHD	BSANT	2945000		53,241,094	0.647%
TOTAL CARTERA				8,224,477,001	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				8,219,035,428	
VAR ESTABLECIDO					2.500%
VAR OBSERVADO (Promedio)					1.624%

Cartera al 29/07/2021 Fondo SAM Balanceado 10, 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:	Especializado en deuda
Calificación:	
Escala homogenea	NA

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