

CARTERA SEMANAL
SAM-RFG
29 FEBRERO 2024



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE		1,440,598	0.297%
S UDIBONO 351122	mxAAA	1,440,598	0.297%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)		3,275,351	0.675%
1ISP SPY *	ALTA	3,275,351	0.675%
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)		480,487,788	99.026%
56SP SAGDBMU LX	NA	480,487,788	99.026%
INVERSION EN DOLARES		11,085	0.002%
CHD BSANT 2945000		11,085	0.002%
TOTAL CARTERA		485,214,821	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		484,636,773	
VAR ESTABLECIDO			3.000%
VAR OBSERVADO (Promedio)			1.264%

Cartera al 29/02/2024 Fondo SAM Balanceado 18, 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 homogénea	NA

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

Tenencia Indirecta en la cartera de SAGDBMU
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
INTRUMENTOS DE RENTA FIJA		
PIMCO SELECT FUNDS PLC - US DOLLAR SHORT-TERM	39,913,793	8.307%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 5.0 04/23	28,157,530	5.860%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 2%	15,807,509	3.290%
UNITED STATES OF AMERICA BOND FIXED 1.875%	13,683,513	2.848%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 4.5 04/23	12,696,085	2.642%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 4 4/20	12,384,568	2.577%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 4.0 03/24	11,862,187	2.469%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 6.0 03/24	11,741,408	2.444%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 3 4/20	9,701,686	2.019%
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA BOND FIXED 10.5%	9,161,625	1.907%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 5.5 04/24	9,140,127	1.902%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.625%	8,788,569	1.829%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.125%	8,191,776	1.705%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.375%	7,880,213	1.640%
FEDERATIVE REPUBLIC OF BRAZIL BILL ZERO CPN	7,444,184	1.549%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 3.5 04/23	6,619,160	1.378%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 4.5 03/24	5,741,013	1.195%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.375%	5,589,952	1.163%
NATIONAL BANK OF HUNGARY BILL ZERO CPN	4,142,984	0.862%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.5%	3,819,890	0.795%
VARIOS	248,020,015	51.618%
Total Tenencia Indirecta en SAGDBMU	480,487,787	100.000%