

**CARTERA SEMANAL
STER10P
29 FEBRERO 2024**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			716,877,759	16.451%
IS	BPA182	270401 mxAAA	349,288,051	8.015%
M	BONOS	260305 mxAAA	367,588,708	8.435%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO			506,644,567	11.626%
IM	BPAQ28	240509 mxAAA	103,307,029	2.371%
IM	BPAQ28	240808 mxAAA	102,098,889	2.343%
IM	VARIOS		183,965,228	4.222%
IQ	VARIOS		52,952,230	1.215%
IS	VARIOS		64,321,190	1.478%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS			104,137,276	2.390%
91	VARIOS		104,137,276	2.390%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL			2,242,958	0.051%
93	VARIOS		2,242,958	0.051%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO			252,371,803	5.791%
94	VARIOS		252,371,803	5.791%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)			155,766,732	3.574%
BI	VARIOS		155,766,732	3.574%
CEDES			247,207,328	5.673%
F	VARIOS		247,207,328	5.673%
PRLV			39,398,302	0.904%
I	VARIOS		39,398,302	0.904%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES			9,014,639	0.207%
J1	CABEI	1-22S mxAAA	9,014,639	0.207%
BONOS			10,902,389	0.250%
M	BONOS	260903 mxAAA	10,902,389	0.250%
INVERSION EN DOLARES			84	0.000%
CHD	BSANT	2945000	84	0.000%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC			45,109,259	1.035%
D8	MSF0925	FLOAT A-	45,109,259	1.035%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.			78,133,867	1.793%
95	VARIOS		78,133,867	1.793%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D			544,571,483	12.497%
LD	BONDES D	240404 mxAAA	129,273,586	2.968%
LD	BONDES D	240425 mxAAA	94,713,932	2.173%
LD	BONDES D	241024 mxAAA	114,775,521	2.634%
LD	BONDES D	241219 mxAAA	92,945,616	2.133%
LD	VARIOS		112,862,828	2.590%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS			668,772	0.015%
SWP	VARIOS		668,772	0.015%
			75,886,463	1.741%
CD	VARIOS		75,886,463	1.741%
			1,437,281,127	32.982%
LF	BONDES F	240321 mxAAA	100,243,959	2.300%
LF	BONDES F	240815 mxAAA	159,175,486	3.653%
LF	BONDES F	241024 mxAAA	217,675,120	4.995%
LF	BONDES F	241107 mxAAA	218,148,129	5.006%
LF	BONDES F	250116 mxAAA	197,046,468	4.522%
LF	BONDES F	250130 mxAAA	97,138,883	2.229%
LF	VARIOS		447,853,082	10.277%
LG	VARIOS		131,790,803	3.024%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			-222,204	-0.005%
AIM	VARIOS		455,895	0.010%
EAIM	VARIOS		-678,100	-0.016%
TOTAL CARTERA			4,357,783,406	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			4,355,037,561	
VAR ESTABLECIDO				0.060%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.009%

Cartera al 29/02/2024 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 16, 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