

CARTERA SEMANAL
STERGOB
 29 FEBRERO 2024



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			19,362,738,761	20.560%
BI	VARIOS		1,000,312,496	1.062%
IM	VARIOS		1,700,531,716	1.806%
IQ	VARIOS		3,370,100,422	3.579%
IS	VARIOS		2,968,637,321	3.152%
LF	BONDESF	270128	3,422,617,219	3.634%
M	VARIOS		263,618,816	0.280%
S	UDIBONO	261203	2,924,645,091	3.106%
S	UDIBONO	261203	3,712,277,680	3.942%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO			12,003,726,256	12.746%
IM	BPAG28	240509	2,508,919,438	2.664%
IM	BPAG28	240808	2,228,441,021	2.366%
IM	VARIOS		3,446,359,658	3.659%
IQ	VARIOS		2,824,212,003	2.999%
IS	VARIOS		995,794,137	1.057%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)			3,071,018,442	3.261%
BI	VARIOS		3,071,018,442	3.261%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D			14,381,549,655	15.271%
LD	BONDES	240404	4,259,166,471	4.523%
LD	BONDES	241024	2,431,833,958	2.582%
LD	BONDES	241219	2,340,603,467	2.485%
LD	VARIOS		5,349,945,760	5.681%
			42,543,671,606	45.175%
LF	BONDES	240314	2,225,065,957	2.363%
LF	BONDES	240321	2,081,736,121	2.210%
LF	BONDES	240425	2,361,866,528	2.508%
LF	BONDES	240523	1,935,603,298	2.055%
LF	BONDES	240815	6,836,442,762	7.259%
LF	BONDES	241024	6,205,714,647	6.589%
LF	BONDES	241107	6,320,035,382	6.711%
LF	BONDES	241128	2,298,305,985	2.440%
LF	BONDES	250116	3,878,227,665	4.118%
LF	BONDES	250130	4,032,362,936	4.282%
LF	VARIOS		4,368,311,326	4.638%
			2,813,139,710	2.987%
LG	VARIOS		2,813,139,710	2.987%
TOTAL CARTERA			94,175,844,431	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			94,111,731,019	
VAR ESTABLECIDO				0.015%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.004%

Cartera al 29/02/2024 FONDO SAM DEUDA CORTO PLAZO 6, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION 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/1S&P

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