

CARTERA SEMANAL
ST&ER-4
29 FEBRERO 2024



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			56,049,068	13.533%
IS	BPA182 260219	mxAAA	56,049,068	13.533%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO			49,994,960	12.071%
IQ	BPAG91 240829	mxAAA	49,994,960	12.071%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.			0	0.000%
2	ACERMEX 86		0	0.000%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS			12,985,529	3.135%
91	VARIOS		12,985,529	3.135%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)			50,172,817	12.114%
BI	CETES 241003	HR1	28,101,465	6.785%
BI	CETES 241128	HR1	9,051,952	2.186%
BI	CETES 250710	HR1	13,019,400	3.144%
BONOS			81,631,139	19.710%
M	BONOS 270603	mxAAA	19,257,159	4.650%
M	BONOS 290531	mxAAA	9,922,986	2.396%
M	BONOS 310529	mxAAA	13,217,762	3.191%
M	BONOS 330526	mxAAA	22,871,954	5.522%
M	BONOS 341123	mxAAA	9,222,226	2.227%
M	VARIOS		7,139,052	1.724%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS			5,633,497	1.360%
S	VARIOS		5,633,497	1.360%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES			525,206	0.127%
MC	BONOS 290531	mxAAA	525,206	0.127%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES			12,213,345	2.949%
MP	BONOS 290531	mxAAA	12,213,345	2.949%
INVERSION EN DOLARES			627,828	0.152%
CHD	BSANT 2945000		627,828	0.152%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.			88,100,980	21.272%
95	CFE 14-2	mxAAA	19,106,761	4.613%
95	PEMEX 13-2	AA+mx	50,293,843	12.144%
95	PEMEX 19	AA+mx	12,116,704	2.926%
95	VARIOS		6,583,673	1.590%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D			55,215,290	13.332%
LD	BONDESD 241024	mxAAA	55,215,290	13.332%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS			1,933,272	0.467%
SWP	VARIOS		1,933,272	0.467%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			-921,111	-0.222%
AIM	VARIOS		400,162	0.097%
EAIM	VARIOS		-1,321,273	-0.319%
TOTAL CARTERA			414,161,819	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			413,644,100	
VAR ESTABLECIDO				0.450%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.206%

Cartera al 29/02/2024 Fondo SAM Deuda 3, 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: Mediano plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/3S&P

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