

CARTERA SEMANAL
ST&ER-7
29 FEBRERO 2024



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				39,577,305	9.149%
LF	BONDESF	261231	mxAAA	39,577,305	9.149%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				8,292,336	1.917%
91	VARIOS			8,292,336	1.917%
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACION (CETES)				4,556,111	1.053%
BI	CETES	250109	HR1	4,556,111	1.053%
BONOS				304,594,975	70.409%
M	BONOS	250306	mxAAA	8,784,308	2.031%
M	BONOS	260305	mxAAA	10,382,744	2.400%
M	BONOS	260903	mxAAA	9,734,276	2.250%
M	BONOS	270304	mxAAA	23,101,387	5.340%
M	BONOS	270603	mxAAA	17,909,158	4.140%
M	BONOS	290531	mxAAA	51,698,759	11.950%
M	BONOS	310529	mxAAA	67,032,937	15.495%
M	BONOS	330526	mxAAA	50,135,323	11.589%
M	BONOS	341123	mxAAA	27,758,900	6.417%
M	BONOS	421113	mxAAA	23,170,953	5.356%
M	VARIOS			14,886,229	3.441%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				12,899,953	2.982%
S	UDIBONO	311127	mxAAA	12,899,953	2.982%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES				656,508	0.152%
MC	BONOS	290531	mxAAA	656,508	0.152%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES				15,266,678	3.529%
MP	BONOS	290531	mxAAA	15,266,678	3.529%
INVERSION EN DOLARES				254,051	0.059%
CHD	BSANT	2945000		254,051	0.059%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				44,111,208	10.197%
95	PEMEX	13-2	AA+ mx	39,229,198	9.068%
95	VARIOS			4,882,011	1.129%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				1,801,764	0.416%
SWP	VARIOS			1,801,764	0.416%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				597,309	0.138%
AIM	VARIOS			1,210,421	0.280%
EAIM	VARIOS			-613,112	-0.142%
TOTAL CARTERA				432,608,197	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				433,040,580	
VAR ESTABLECIDO					0.800%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.550%

Cartera al 29/02/2024 Fondo SAM Deuda 4, 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:	Largo plazo
Calificación:	
Escala homogénea	AAA/SS&P

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