

**CARTERA SEMANAL
ST&ER1P**
29 FEBRERO 2024



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				535,580,827	31.004%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	236,170,477	13.671%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	200,060,431	11.581%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	99,349,919	5.751%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				193,951,168	11.227%
IM	BPAG28	240509	mxAAA	37,375,348	2.164%
IM	BPAG28	240808	mxAAA	39,977,877	2.314%
IM	VARIOS			61,587,419	3.565%
IQ	VARIOS			34,202,557	1.980%
IS	VARIOS			20,807,966	1.205%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				68,788,749	3.982%
BI	VARIOS			68,788,749	3.982%
CEDES				86,874,156	5.029%
F	VARIOS			86,874,156	5.029%
PRLV				18,657,070	1.080%
I	VARIOS			18,657,070	1.080%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D				192,110,059	11.121%
LD	BONDES D	240404	mxAAA	40,171,465	2.325%
LD	BONDES D	241024	mxAAA	39,442,791	2.283%
LD	BONDES D	241219	mxAAA	37,439,217	2.167%
LD	VARIOS			75,056,586	4.345%
				2,614,478	0.151%
CD	NAFR	241118	mxAAA	2,614,478	0.151%
				576,325,413	33.362%
LF	BONDES F	240815	mxAAA	100,584,510	5.823%
LF	BONDES F	241024	mxAAA	108,837,560	6.300%
LF	BONDES F	241107	mxAAA	89,449,200	5.178%
LF	BONDES F	250116	mxAAA	77,132,282	4.465%
LF	BONDES F	250130	mxAAA	42,974,362	2.488%
LF	VARIOS			157,347,500	9.108%
				52,581,181	3.044%
LG	VARIOS			52,581,181	3.044%
TOTAL CARTERA				1,727,483,101	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,724,780,415	
VAR ESTABLECIDO					0.060%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.005%

Cartera al 29/02/2024 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 11, 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