

**CARTERA SEMANAL**  
SAM-RFG  
25 ABRIL 2024



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
<b>TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE</b>		<b>4,849,351</b>	<b>1.017%</b>
M	BONOS 310529 mxAAA	4,849,351	1.017%
<b>TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)</b>		<b>3,276,079</b>	<b>0.687%</b>
1ISP	SPY * ALTA	3,276,079	0.687%
<b>SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)</b>		<b>468,613,055</b>	<b>98.293%</b>
56SP	SAGDBMU LX NA	468,613,055	98.293%
<b>INVERSION EN DOLARES</b>		<b>11,188</b>	<b>0.002%</b>
CHD	BSANT 2945000	11,188	0.002%
<b>TOTAL CARTERA</b>		<b>476,749,673</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>		<b>473,944,626</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>			<b>3.000%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>			<b>1.255%</b>

Cartera al 25/04/2024 Fondo SAM Balanceado 18, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable

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.

<b>Categoría:</b>	Especializado en deuda
<b>Calificación:</b>	
<b>Escala homogénea</b>	NA

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

**Tenencia Indirecta en la cartera de SAGDBMU**

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS CORPORATIVOS RENTA FIJA		
PIMCO SELECT FUNDS PLC - US DOLLAR SHORT-TERM	41,487,473	8.853%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 5.0 06/24	27,603,352	5.890%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 4.5 06/24	18,010,275	3.843%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 2%	15,998,806	3.414%
UNITED STATES OF AMERICA BOND FIXED 1.875%	13,086,458	2.793%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 4.0 06/24	12,069,176	2.576%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 6.0 05/24	11,738,211	2.505%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 4.0 05/24	11,584,918	2.472%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 3.0 06/24	9,413,411	2.009%
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA BOND FIXED 10.5%	9,270,655	1.978%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 5.5 05/24	9,052,153	1.932%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.625%	8,703,031	1.857%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.125%	8,099,248	1.728%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.375%	7,777,493	1.660%
FEDERATIVE REPUBLIC OF BRAZIL BILL ZERO CPN	7,294,366	1.557%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 3.5 6/20	6,437,743	1.374%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.375%	5,620,244	1.199%
UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.5%	3,863,222	0.824%
BLACK DIAMOND CLO 2017-2 DAC 2017-2A A1 FLOATING	3,557,752	0.759%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 5 6/20	3,397,607	0.725%
VARIOS	234,547,462	50.051%
<b>Total Tenencia Indirecta en SAGDBMU</b>	<b>468,613,055</b>	<b>100.000%</b>