

CARTERA SEMANAL
ST&ER-4
25 ABRIL 2024



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				87,086,727	20.003%
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	78,338,522	17.993%
LD	BONDES	241024	mxAAA	8,748,205	2.009%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				50,877,839	11.686%
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	50,877,839	11.686%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.				0	0.000%
2	ACERMEX	86		0	0.000%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				16,922,179	3.887%
91	VARIOS			16,922,179	3.887%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				4,019,748	0.923%
94	COMPART	24S	AA.mx	4,019,748	0.923%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				50,911,639	11.694%
BI	CETES	241003	HR1	28,570,218	6.562%
BI	CETES	241128	HR1	9,198,737	2.112%
BI	CETES	250710	HR1	13,144,684	3.019%
BONOS				115,629,118	26.558%
M	BONOS	270603	mxAAA	19,118,559	4.391%
M	BONOS	290531	mxAAA	9,721,708	2.233%
M	BONOS	310529	mxAAA	15,106,955	3.470%
M	BONOS	330526	mxAAA	17,656,843	4.056%
M	BONOS	341123	mxAAA	8,856,333	2.034%
M	BONOS	421113	mxAAA	28,930,505	6.645%
M	BONOS	530731	mxAAA	13,153,812	3.021%
M	VARIOS			3,084,403	0.708%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				5,664,863	1.301%
S	VARIOS			5,664,863	1.301%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES				509,291	0.117%
MC	BONOS	290531	mxAAA	509,291	0.117%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES				11,843,240	2.720%
MP	BONOS	290531	mxAAA	11,843,240	2.720%
INVERSION EN DOLARES				637,811	0.146%
CHD	JPMOR	3584000		637,811	0.146%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				90,191,561	20.716%
95	CFE	14-2	mxAAA	19,252,011	4.422%
95	PEMEX	13-2	AA+.mx	49,482,511	11.365%
95	PEMEX	19	AA+.mx	12,119,264	2.784%
95	VARIOS			9,337,775	2.145%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				2,098,864	0.482%
SWP	VARIOS			2,098,864	0.482%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				-1,015,906	-0.233%
AIM	VARIOS			378,594	0.087%
EAIM	VARIOS			-1,394,500	-0.320%
TOTAL CARTERA				435,376,976	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				432,568,852	
VAR ESTABLECIDO					0.450%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.249%

Cartera al 25/04/2024 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