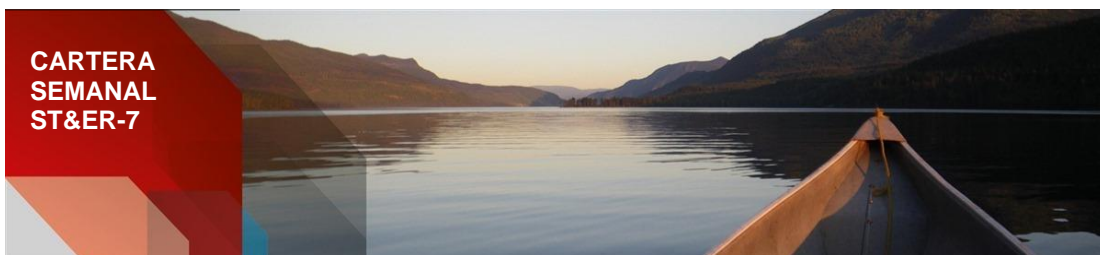


CARTERA SEMANAL
ST&ER-7
25 ABRIL 2024



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				63,080,750	14.116%
LF	BONDESF	270318	mxAAA	63,080,750	14.116%
TÍTULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS				5,878,909	1.316%
JE	AMX	0129	mxAAA	5,878,909	1.316%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				8,040,014	1.799%
91	BBVALMX	18-2	AAA(mex)	8,040,014	1.799%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				4,839,344	1.083%
94	BACOMER	19-2	AAA,mx	4,839,344	1.083%
BONOS				291,574,363	65.247%
M	BONOS	260305	mxAAA	10,073,100	2.254%
M	BONOS	260903	mxAAA	9,343,148	2.091%
M	BONOS	270304	mxAAA	22,229,341	4.974%
M	BONOS	270603	mxAAA	17,780,260	3.979%
M	BONOS	290531	mxAAA	40,928,392	9.159%
M	BONOS	310529	mxAAA	58,138,889	13.010%
M	BONOS	330526	mxAAA	35,137,117	7.863%
M	BONOS	341123	mxAAA	35,513,896	7.947%
M	BONOS	421113	mxAAA	17,819,514	3.988%
M	BONOS	530731	mxAAA	26,503,790	5.931%
M	VIARIOS			18,106,915	4.052%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				12,471,203	2.791%
S	UDIBONO	311127	mxAAA	12,471,203	2.791%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES				636,614	0.142%
MC	BONOS	290531	mxAAA	636,614	0.142%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES				14,804,047	3.313%
MP	BONOS	290531	mxAAA	14,804,047	3.313%
INVERSION EN DOLARES				258,091	0.058%
CHD	JPMOR	3584000		258,091	0.058%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				43,384,296	9.708%
95	PEMEX	13-2	AA+,mx	38,596,359	8.637%
95	VIARIOS			4,787,937	1.071%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				1,450,896	0.325%
SWP	VIARIOS			1,450,896	0.325%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				461,469	0.103%
AIM	VIARIOS			557,445	0.125%
EAIM	VIARIOS			-95,975	-0.021%
TOTAL CARTERA				446,879,996	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				445,779,771	
VAR ESTABLECIDO					0.800%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.579%

Cartera al 25/04/2024 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