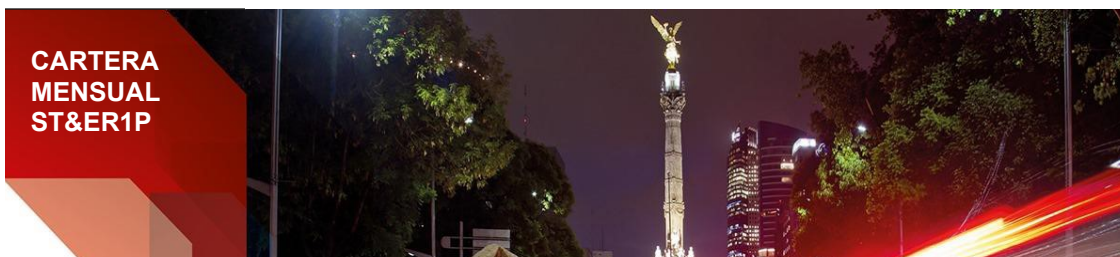


**CARTERA MENSUAL
ST&ER1P
DICIEMBRE 2023**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				426,800,630	26.198%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	83,556,961	5.129%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	115,102,666	7.065%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	150,188,603	9.219%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	77,952,400	4.785%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				269,732,978	16.557%
IM	BPAG28	240208	mxAAA	55,420,995	3.402%
IM	BPAG28	240509	mxAAA	37,331,641	2.291%
IM	BPAG28	240808	mxAAA	39,930,888	2.451%
IM	VIARIOS			56,716,392	3.481%
IQ	BPAG81	240111	mxAAA	33,342,747	2.047%
IQ	VIARIOS			31,304,709	1.922%
IS	VIARIOS			15,685,607	0.963%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				60,648,002	3.723%
BI	VIARIOS			60,648,002	3.723%
CEDES				87,635,552	5.379%
F	VIARIOS			87,635,552	5.379%
PRLV				21,500,217	1.320%
I	VIARIOS			21,500,217	1.320%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D				220,875,556	13.558%
LD	BONDESD	240201	mxAAA	34,073,340	2.091%
LD	BONDESD	240404	mxAAA	40,125,840	2.463%
LD	BONDESD	241024	mxAAA	39,397,760	2.418%
LD	VIARIOS			107,278,616	6.585%
				2,611,861	0.160%
CD	NAFR	241118	mxAAA	2,611,861	0.160%
				493,517,699	30.293%
LF	BONDESF	240201	mxAAA	47,581,024	2.921%
LF	BONDESF	240229	mxAAA	104,023,533	6.385%
LF	BONDESF	240815	mxAAA	101,349,029	6.221%
LF	BONDESF	241024	mxAAA	33,694,786	2.068%
LF	BONDESF	241107	mxAAA	81,669,730	5.013%
LF	VIARIOS			125,199,597	7.685%
				45,831,022	2.813%
LG	BONDESG	240321	mxAAA	33,644,098	2.065%
LG	VIARIOS			12,186,925	0.748%
TOTAL CARTERA				1,629,153,518	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,626,782,351	
VAR ESTABLECIDO					0.060%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.007%

Cartera al 29/12/2023 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: Corta plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/2S&P

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