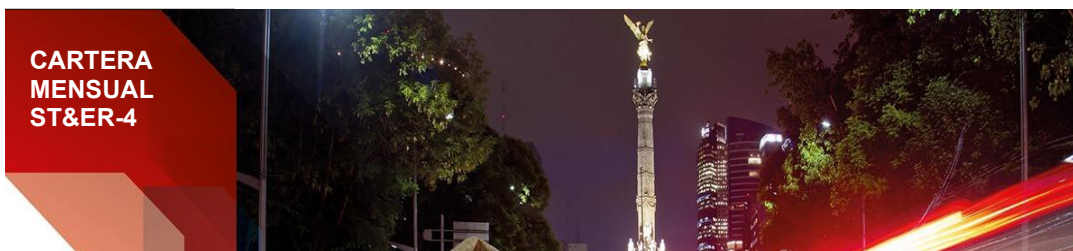


**CARTERA MENSUAL
ST&ER-4**
DICIEMBRE 2023



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%	
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			109,180,564	26.996%	
2U	CBIC002	300117	mxAAA	54,669,000	13.518%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	28,200,268	6.973%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	26,311,296	6.506%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.			0	0.000%	
2	ACERMEX	86		0	0.000%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS			13,040,456	3.224%	
91	VARIOS			13,040,456	3.224%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)			49,358,142	12.204%	
BI	CETES	241003	HR1	27,629,787	6.832%
BI	CETES	241128	HR1	8,902,429	2.201%
BI	CETES	250710	HR1	12,825,926	3.171%
BONOS			50,506,376	12.488%	
M	BONOS	270603	mxAAA	19,082,605	4.718%
M	BONOS	290531	mxAAA	9,872,627	2.441%
M	BONOS	330526	mxAAA	13,717,848	3.392%
M	VARIOS			7,833,296	1.937%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS			5,571,445	1.378%	
S	VARIOS			5,571,445	1.378%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES			524,190	0.130%	
MC	BONOS	290531	mxAAA	524,190	0.130%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES			12,189,702	3.014%	
MP	BONOS	290531	mxAAA	12,189,702	3.014%
INVERSION EN DOLARES			624,599	0.154%	
CHD	BSANT	2945000		624,599	0.154%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.			87,159,869	21.551%	
95	CFE	14-2	mxAAA	18,874,732	4.667%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	49,309,122	12.192%
95	PEMEX	19	mxAAA	12,122,300	2.997%
95	VARIOS			6,853,716	1.695%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D			75,207,615	18.596%	
LD	BONDES D	241024	mxAAA	75,207,615	18.596%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS			1,975,256	0.488%	
SWP	VARIOS			1,975,256	0.488%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			-911,994	-0.226%	
AIM	VARIOS			434,533	0.107%
EAIM	VARIOS			-1,346,527	-0.333%
TOTAL CARTERA			404,426,220	100.000%	
VALOR DEL ACTIVO NETO			403,838,119		
VAR ESTABLECIDO				0.450%	
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.185%	

Cartera al 29/12/2023 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