

**CARTERA SEMANAL DEUDAOP**  
18 JULIO 2024



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
<b>TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE</b>			<b>600,949,759</b>	<b>4.833%</b>
IQ	BPA691	251231 mxAAA	600,949,759	4.833%
<b>SERVICIOS FINANCIEROS</b>			<b>1,360,553</b>	<b>0.011%</b>
0	UNIFIN	A NULA	1,360,553	0.011%
<b>BONOS DE PROTECCION AL AHORRO</b>			<b>2,338,780,832</b>	<b>18.808%</b>
IM	VARIOS		49,841,459	0.401%
IQ	VARIOS		747,439,459	6.011%
IS	BPA182	250306 mxAAA	260,208,695	2.093%
IS	BPA182	260219 mxAAA	809,763,881	6.512%
IS	VARIOS		471,527,339	3.782%
<b>CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS</b>			<b>1,197,961,524</b>	<b>9.634%</b>
91	VARIOS		1,197,961,524	9.634%
<b>CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO</b>			<b>754,334,036</b>	<b>6.066%</b>
94	VARIOS		754,334,036	6.066%
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)</b>			<b>4,241,072,631</b>	<b>34.105%</b>
BI	CETES	251030 HR1	1,230,290,461	9.894%
BI	CETES	251224 HR1	1,454,947,525	11.700%
BI	CETES	260219 HR1	748,837,995	6.022%
BI	CETES	260416 HR1	291,818,633	2.345%
BI	VARIOS		515,378,017	4.144%
<b>TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES</b>			<b>150,438,275</b>	<b>1.210%</b>
J1	VARIOS		150,438,275	1.210%
<b>BONOS</b>			<b>632,779,443</b>	<b>5.089%</b>
M	VARIOS		632,779,443	5.089%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS</b>			<b>313,420,635</b>	<b>2.520%</b>
S	UDIBONO	251204 mxAAA	302,562,685	2.433%
S	VARIOS		10,857,950	0.087%
<b>BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES</b>			<b>10,990,521</b>	<b>0.088%</b>
MC	BONOS	290531 mxAAA	10,990,521	0.088%
<b>BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES</b>			<b>305,426,047</b>	<b>2.456%</b>
MP	BONOS	290531 mxAAA	305,426,047	2.456%
<b>INVERSION EN DOLARES</b>			<b>38,681,356</b>	<b>0.311%</b>
CHD	VARIOS		38,681,356	0.311%
<b>TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>			<b>494,209,765</b>	<b>3.974%</b>
D8	VARIOS		494,209,765	3.974%
<b>VALORES PARAESTATALES A RENDIM.</b>			<b>1,192,831,977</b>	<b>9.592%</b>
95	PEMEX	13-2 AA+ mx	775,174,496	6.234%
95	VARIOS		417,657,481	3.359%
<b>OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS</b>			<b>22,694,541</b>	<b>0.183%</b>
SWP	VARIOS		22,694,541	0.183%
			<b>82,109,136</b>	<b>0.660%</b>
CD	VARIOS		82,109,136	0.660%
			<b>70,107,082</b>	<b>0.564%</b>
LG	BONDESG	250710 mxAAA	70,107,082	0.564%
<b>APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS</b>			<b>-12,902,730</b>	<b>-0.104%</b>
AIM	VARIOS		9,000,797	0.072%
EAIM	VARIOS		-21,903,526	-0.176%
<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>12,435,245,384</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>			<b>12,303,251,408</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>				<b>0.700%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>				<b>0.132%</b>

Cartera al 18/07/2024 Fondo SAM Deuda 8, 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: Discrecional

Calificación:

Escala homogénea AAA/3&P

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