

CARTERA SEMANAL
ST&ER-4
18 JULIO 2024



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				88,283,080	21.360%
IQ	BPAG91	251231	mxAAA	40,012,214	9.681%
S	UDIBONO	311127	mxAAA	48,270,866	11.679%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				50,768,893	12.284%
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	50,768,893	12.284%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.				0	0.000%
2	ACERMEX	86		0	0.000%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				17,251,996	4.174%
91	VARIOS			17,251,996	4.174%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				4,019,748	0.973%
94	COMPART	24S	AA.mx	4,019,748	0.973%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				52,209,694	12.632%
BI	CETES	241003	HR1	29,310,072	7.092%
BI	CETES	241128	HR1	9,431,969	2.282%
BI	CETES	250710	HR1	13,467,554	3.259%
BONOS				89,970,821	21.769%
M	BONOS	270603	mxAAA	18,876,920	4.567%
M	BONOS	290531	mxAAA	9,537,437	2.308%
M	BONOS	310529	mxAAA	14,899,982	3.605%
M	BONOS	330526	mxAAA	23,882,302	5.778%
M	BONOS	341123	mxAAA	8,706,913	2.107%
M	VARIOS			14,067,267	3.404%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				5,709,771	1.382%
S	VARIOS			5,709,771	1.382%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES				522,525	0.126%
MC	BONOS	290531	mxAAA	522,525	0.126%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES				12,150,992	2.940%
MP	BONOS	290531	mxAAA	12,150,992	2.940%
INVERSION EN DOLARES				674,190	0.163%
CHD	JPMOR	3584000		674,190	0.163%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				91,400,965	22.115%
95	CFE	14-2	mxAAA	19,223,564	4.651%
95	PEMEX	13-2	AA+.mx	50,918,019	12.320%
95	PEMEX	19	AA+.mx	12,098,695	2.927%
95	VARIOS			9,160,687	2.216%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				1,197,860	0.290%
SWP	VARIOS			1,197,860	0.290%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				-858,732	-0.208%
AIM	VARIOS			313,471	0.076%
EAIM	VARIOS			-1,172,203	-0.284%
TOTAL CARTERA				413,301,703	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				413,258,022	
VAR ESTABLECIDO					0.450%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.247%

Cartera al 18/07/2024 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