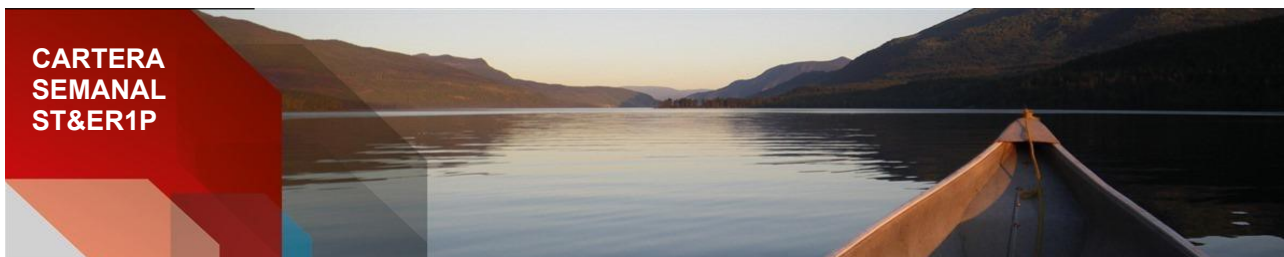


**CARTERA SEMANAL
ST&ER1P**
25 ENERO 2024



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				413,558,104	24.586%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	8,086	0.000%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	150,045,600	8.920%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	159,938,525	9.508%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	103,565,894	6.157%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				248,143,813	14.752%
IM	BPAG28	240208	mxAAA	55,355,968	3.291%
IM	BPAG28	240509	mxAAA	37,289,978	2.217%
IM	BPAG28	240808	mxAAA	39,886,265	2.371%
IM	VARIOS			61,886,453	3.667%
IQ	VARIOS			35,349,562	2.102%
IS	VARIOS			18,575,588	1.104%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				72,100,488	4.286%
BI	VARIOS			72,100,488	4.286%
CEDES				85,736,781	5.097%
F	VARIOS			85,736,781	5.097%
PRLV				26,536,424	1.578%
I	VARIOS			26,536,424	1.578%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D				249,757,306	14.848%
LD	BONDES D	240201	mxAAA	34,032,962	2.023%
LD	BONDES D	240404	mxAAA	40,078,364	2.383%
LD	BONDES D	241024	mxAAA	39,352,244	2.339%
LD	BONDES D	241219	mxAAA	37,353,312	2.221%
LD	VARIOS			98,940,424	5.882%
				2,608,598	0.155%
CD	NAFR	241118	mxAAA	2,608,598	0.155%
				535,293,624	31.823%
LF	BONDES F	240201	mxAAA	39,066,950	2.323%
LF	BONDES F	240229	mxAAA	102,692,961	6.105%
LF	BONDES F	240815	mxAAA	101,230,379	6.018%
LF	BONDES F	241024	mxAAA	33,654,987	2.001%
LF	BONDES F	241107	mxAAA	90,023,096	5.352%
LF	VARIOS			168,625,251	10.025%
				48,368,925	2.876%
LG	VARIOS			48,368,925	2.876%
TOTAL CARTERA				1,682,104,063	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,678,385,167	
VAR ESTABLECIDO					0.060%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.006%

Cartera al 25/01/2024 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: Corto plazo

Calificación:

Escala homogenea AAA/2S&P

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