

**CARTERA SEMANAL
DEUDAOP**
18 ABRIL 2024



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			
IS	VARIOS	531,893,456	4.069%
LD	VARIOS	44,359,395	0.339%
S	UDIBONO 261203	55,671,158	0.426%
		431,861,903	3.304%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO			
IM	VARIOS	2,948,670,423	22.558%
IQ	BPAG81 250904	50,158,731	0.384%
IQ	VARIOS	303,635,364	2.323%
IS	VARIOS	996,218,874	7.621%
IS	BPA182 260219	787,344,936	6.023%
IS	VARIOS	811,312,518	6.207%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS			
91	VARIOS	1,243,089,267	9.510%
		1,243,089,267	9.510%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL			
93	UNIFIN 00122	0	0.000%
		0	0.000%
CERTIFICADO BURSATIL BANCAIRO			
94	VARIOS	795,470,927	6.086%
		795,470,927	6.086%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)			
BI	CETES 250123	4,077,198,364	31.191%
BI	CETES 251030	280,964,125	2.149%
BI	CETES 251030	1,198,698,136	9.170%
BI	CETES 251224	1,417,885,626	10.847%
BI	CETES 260219	774,645,416	5.926%
BI	VARIOS	405,005,080	3.088%
BONOS BANCARIOS			
J	BSAN C04117	299,147,364	2.289%
		299,147,364	2.289%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES			
JII	VARIOS	149,921,190	1.147%
		149,921,190	1.147%
BONOS			
M	VARIOS	590,977,694	4.521%
		590,977,694	4.521%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS			
S	UDIBONO 251204	308,465,524	2.360%
S	VARIOS	297,853,414	2.279%
		10,612,110	0.081%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES			
MC	BONOS 290531	10,713,021	0.082%
		10,713,021	0.082%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES			
MP	BONOS 290531	295,256,360	2.259%
		295,256,360	2.259%
INVERSION EN DOLARES			
CHD	VARIOS	35,664,104	0.273%
		35,664,104	0.273%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC			
D8	VARIOS	495,473,218	3.790%
		495,473,218	3.790%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.			
95	PEMEX 13-2	1,114,778,862	8.528%
95	VARIOS	751,944,990	5.753%
		362,833,872	2.776%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D			
LD	BONDESD 240627	10,044,137	0.077%
		10,044,137	0.077%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS			
SWP	VARIOS	32,023,236	0.245%
		32,023,236	0.245%
CD			
CD	VARIOS	82,082,342	0.628%
		82,082,342	0.628%
LG			
LG	BONDESG 250710	69,937,830	0.535%
		69,937,830	0.535%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			
AIM	VARIOS	-19,239,724	-0.147%
EAIM	VARIOS	11,180,818	0.086%
		-30,420,542	-0.233%
TOTAL CARTERA		13,071,566,616	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		13,025,586,662	
VAR ESTABLECIDO			0.700%
VAR OBSERVADO (Promedio)			0.127%

Cartera al 18/04/2024 Fondo SAM Deuda S, 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: AAA/3S&P
 Escala homogénea: AAA/3S&P

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