

CARTERA MENSUAL
ST&ER-4
MARZO 2024



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				77,316,404	17.166%
BI	CETES	251030	HR1	27,239,335	6.048%
IS	BPA182	260219	mxAAA	35,779,139	7.944%
LF	BONDESF	251002	mxAAA	14,297,930	3.174%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				50,491,808	11.210%
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	50,491,808	11.210%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.				0	0.000%
2	ACERMEX	86		0	0.000%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				17,136,035	3.805%
91	VARIOS			17,136,035	3.805%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				4,024,385	0.894%
94	COMPART	24S	AA.mx	4,024,385	0.894%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				50,643,409	11.244%
BI	CETES	241003	HR1	28,370,751	6.299%
BI	CETES	241128	HR1	9,141,335	2.030%
BI	CETES	250710	HR1	13,131,323	2.915%
BONOS				88,514,299	19.652%
M	BONOS	270603	mxAAA	19,424,236	4.313%
M	BONOS	290531	mxAAA	9,971,744	2.214%
M	BONOS	310529	mxAAA	15,616,750	3.467%
M	BONOS	330526	mxAAA	22,927,127	5.090%
M	BONOS	341123	mxAAA	9,224,323	2.048%
M	VARIOS			11,350,119	2.520%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				5,673,057	1.260%
S	VARIOS			5,673,057	1.260%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS CUPONES				526,856	0.117%
MC	BONOS	290531	mxAAA	526,856	0.117%
BONOS DEL GOB FED TASA FIJA SEGREGADOS PRINCIPALES				12,251,708	2.720%
MP	BONOS	290531	mxAAA	12,251,708	2.720%
INVERSION EN DOLARES				611,512	0.136%
CHD	JPMOR	3584000		611,512	0.136%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				86,946,664	19.304%
95	CFE	14-2	mxAAA	19,256,431	4.275%
95	PEMEX	13-2	AA+.mx	49,102,182	10.902%
95	PEMEX	19	AA+.mx	12,137,211	2.695%
95	VARIOS			6,450,840	1.432%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D				55,275,277	12.272%
LD	BONDES D	241024	mxAAA	55,275,277	12.272%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				1,885,960	0.419%
SWP	VARIOS			1,885,960	0.419%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				-897,363	-0.199%
AIM	VARIOS			381,327	0.085%
EAIM	VARIOS			-1,278,690	-0.284%
TOTAL CARTERA				450,400,013	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				450,283,745	
VAR ESTABLECIDO					0.450%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.198%

Cartera al 27/03/2024 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