

CARTERA SEMANAL
ST&ER1G
17 JUNIO 2021



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				8,796,227,393	100.000%
IM	BPAG28	230810	AA-(mex)	1,274,038,633	14.484%
IQ	BPAG91	240111	AA-(mex)	629,744,730	7.159%
IQ	BPAG91	240502	AA-(mex)	644,295,972	7.325%
IQ	BPAG91	251231	AA-(mex)	658,985,980	7.492%
LD	BONDESD	240822	AA-(mex)	1,019,232,309	11.587%
LD	BONDESD	251016	AA-(mex)	975,300,165	11.088%
2U	CBIC002	300117	AA-(mex)	1,155,041,837	13.131%
2U	CBIC002	300117	AA-(mex)	1,274,011,729	14.484%
2U	CBIC004	310116	AA-(mex)	617,092,214	7.015%
2U	VARIOS			548,483,825	6.235%
TOTAL CARTERA				8,796,227,393	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				8,789,514,770	
VAR ESTABLECIDO					0.020%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.000%

Cartera al 17/06/2021 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 10, 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 - gubernamental
Calificación:	
Escala homogenea	AAA/IS&P

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