

CARTERA SEMANAL
ST&ER-4
17 JUNIO 2021



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE					
2U	CBIC002	300117	AA-(mex)	67,112,799	6.538%
2U	CBIC004	310116	AA-(mex)	31,154,613	3.035%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO					
IM	VARIOS			40,098,127	3.906%
IQ	VARIOS			20,043,438	1.953%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.					
2	ACERMEX	86		0	0.000%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA					
2U	CBIC004	310116	AA-(mex)	11,377,339	1.108%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS					
91	VARIOS			11,377,339	1.108%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO					
94	VARIOS			39,959,537	3.893%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)					
BI	CETES	211118	F3(mex)	6,262,389	0.610%
BI	CETES	220210	F3(mex)	146,157,527	14.238%
BI	CETES	220310	F3(mex)	49,101,335	4.783%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES					
JL	CABEI	1-19	mxAAA	77,704,048	7.570%
BONOS					
M	BONOS	231207	AA-(mex)	19,352,144	1.885%
M	BONOS	260305	AA-(mex)	7,055,011	0.687%
M	BONOS	310529	AA-(mex)	235,065,559	22.899%
M	BONOS	341123	AA-(mex)	21,229,551	2.068%
M	BONOS	421113	AA-(mex)	77,157,927	7.516%
M	VARIOS			38,664,711	3.767%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS					
S	UDIBONO	220609	AA-(mex)	21,447,047	2.089%
S	UDIBONO	231116	AA-(mex)	32,910,124	3.206%
S	UDIBONO	251204	AA-(mex)	43,656,199	4.253%
INVERSION EN DOLARES					
CHD	BSANT	2945000		354,164	0.035%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.					
95	PEMEX	11-3	A2.mx	130,181,172	12.682%
95	PEMEX	13-2	A2.mx	30,293,038	2.951%
95	VARIOS			48,561,068	4.731%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D					
LD	BONDES D	210722	AA-(mex)	51,327,067	5.000%
LD	BONDES D	211007	AA-(mex)	210,070,272	20.464%
LD	BONDES D	220113	AA-(mex)	50,118,711	4.882%
LD	VARIOS			49,992,341	4.870%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS					
FD	DEUA	SP21		63,966	0.006%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS					
SWP	VARIOS			-723,923	-0.071%
FCSP	VARIOS			-723,923	-0.071%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS					
AIM	VARIOS			-49,836	-0.005%
EAIM	VARIOS			-49,836	-0.005%
TOTAL CARTERA					
				1,026,522,958	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO					
				1,039,707,016	
VAR ESTABLECIDO					
					0.450%
VAR OBSERVADO (Promedio)					
					0.270%

Cartera al 17/06/2021 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 homogenea	AAA/3S&P

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