

**CARTERA SEMANAL**  
**ST&ER-7**  
17 JUNIO 2021



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE					56,357,506 9.245%
2U	CBIC002	300117	AA-(mex)	56,357,506	9.245%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA					28,443,349 4.666%
2U	CBIC004	310116	AA-(mex)	28,443,349	4.666%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS					51,098,331 8.383%
91	VARIOS			51,098,331	8.383%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO					9,605,129 1.576%
94	COMPART	16-2	mxAA	9,605,129	1.576%
BONOS					278,876,577 45.750%
M	BONOS	260305	AA-(mex)	59,789,907	9.809%
M	BONOS	270603	AA-(mex)	43,531,899	7.141%
M	BONOS	290531	AA-(mex)	50,068,065	8.214%
M	BONOS	310529	AA-(mex)	40,812,751	6.695%
M	BONOS	381118	AA-(mex)	16,270,292	2.669%
M	BONOS	421113	AA-(mex)	48,999,518	8.038%
M	VARIOS			19,404,144	3.183%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS					19,907,941 3.266%
S	UDIBONO	251204	AA-(mex)	19,907,941	3.266%
INVERSION EN DOLARES					720,756 0.118%
CHD	BSANT	2945000		720,756	0.118%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.					163,402,673 26.806%
95	CFE	13-2	Aaa.mx	17,389,138	2.853%
95	PEMEX	11-3	A2.mx	93,467,148	15.333%
95	PEMEX	13-2	A2.mx	37,877,633	6.214%
95	VARIOS			14,668,754	2.406%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS					88,334 0.014%
FD	DEUA	SP21		88,334	0.014%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS					-4,333,323 -0.711%
SWP	VARIOS			-4,333,323	-0.711%
					-33,224 -0.005%
FCSP	VARIOS			-33,224	-0.005%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS					5,433,123 0.891%
AIM	VARIOS			2,342,385	0.384%
EAIM	VARIOS			3,090,738	0.507%
TOTAL CARTERA					609,567,171 100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO					606,969,796
VAR ESTABLECIDO					0.800%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.599%

Cartera al 17/06/2021 Fondo SAM Deuda 4, 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:	Largo plazo
Calificación:	
Escala homogenea	AAA/5S&P

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