

**CARTERA MENSUAL
STERGOB
MAYO 2023**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			14,938,906,246	18.808%
IM	VARIOS		189,160,090	0.238%
IS	VARIOS		623,368,855	0.785%
LF	BONDESF	250724 mxAAA	2,143,012,337	2.698%
LF	VARIOS		6,025,373,641	7.586%
M	BONOS	471107 mxAAA	1,856,300,803	2.337%
M	VARIOS		628,581,937	0.791%
S	UDIBONO	261203 mxAAA	3,473,108,585	4.373%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO			13,993,279,546	17.617%
IM	VARIOS		8,299,103,082	10.448%
IQ	BPAG91	230831 mxAAA	3,599,757,429	4.532%
IQ	VARIOS		1,901,879,397	2.394%
IS	VARIOS		192,539,638	0.242%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)			6,559,074,280	8.258%
BI	CETES	230601 HR1	1,781,190,000	2.242%
BI	VARIOS		4,777,884,280	6.015%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS			907,906,810	1.143%
S	UDIBONO	231116 mxAAA	907,906,810	1.143%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D			25,254,604,980	31.795%
LD	BONDES D	231101 mxAAA	5,171,110,646	6.510%
LD	BONDES D	231221 mxAAA	8,067,254,462	10.156%
LD	BONDES D	240404 mxAAA	2,264,823,977	2.851%
LD	VARIOS		9,751,415,895	12.277%
			16,345,055,747	20.578%
LF	BONDES F	230831 mxAAA	2,222,130,135	2.798%
LF	BONDES F	231005 mxAAA	3,779,761,132	4.759%
LF	BONDES F	240314 mxAAA	1,597,718,590	2.011%
LF	VARIOS		8,745,445,890	11.010%
			1,430,788,449	1.801%
LG	VARIOS		1,430,788,449	1.801%
TOTAL CARTERA			79,429,616,058	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			79,085,809,890	
VAR ESTABLECIDO				0.015%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.008%

Cartera al 31/05/2023 FONDO SAM DEUDA CORTO PLAZO 6, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION 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 homogénea AAA/1S&P

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