

**CARTERA MENSUAL
STERMXN**
OCTUBRE 2024



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				11,289,750,980	47.071%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	27,941	0.000%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	2,305,814,838	9.614%
2U	CBIC002	300117	mxAAA	1,500,432,381	6.256%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	3,482,368,125	14.519%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	500,116,190	2.085%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	3,500,991,504	14.597%
TRACS EXTRANJEROS FIX				12,615,993,112	52.601%
1I	IB1MXX	N	ALTA	3,432,707,368	14.312%
1I	MBIL	N	ALTA	2,821,015,992	11.762%
1I	TMX1X	N	BAJA	4,242,806,805	17.690%
1I	VMSTX	N	ALTA	2,119,462,947	8.837%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				77,370,551	0.323%
1ISP	USMV	*	MEDIA	77,370,551	0.323%
INVERSION EN DOLARES				1,258,903	0.005%
CHD	BSANT	2945000		1,258,903	0.005%
TOTAL CARTERA				23,984,373,546	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				23,997,459,960	
VAR ESTABLECIDO					0.300%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.009%

Cartera al 31/10/2024 Fondo SAM Renta Variable 21, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable

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: Discrecional

Calificación:

Escala homogénea NA

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