

**CARTERA MENSUAL
ST&ER-5
DICIEMBRE 2022**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				26,735,295	1.263%
BI	CETES	231214	HR1	26,735,295	1.263%
INVERSION EN DOLARES				2,089,238,839	98.737%
CHD	BACOM	4746900		319,653	0.015%
CHD	BSANT	2945000		108,753,434	5.140%
CHD	JPMOR	3584000		1,980,165,752	93.582%
TOTAL CARTERA				2,115,974,134	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				2,121,527,420	
VAR ESTABLECIDO					2.600%
VAR OBSERVADO (Promedio)					1.180%

Cartera al 30/12/2022 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 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: Corto plazo en moneda extranjera

Calificación:

Escala homogénea: AAA/6S&P

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