

CARTERA SEMANAL
ST&ER-5
26 ENERO 2023



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%	
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			66,309,904	3.046%	
LD	BONDESD	240201	mxAAA	66,309,904	3.046%
INVERSION EN DOLARES			2,110,610,184	96.954%	
CHD	BACOM	4746900		308,138	0.014%
CHD	BSANT	2945000		197,358,300	9.066%
CHD	JPMOR	3584000		1,912,943,746	87.874%
TOTAL CARTERA			2,176,920,088	100.000%	
VALOR DEL ACTIVO NETO			2,119,461,518		
VAR ESTABLECIDO				2.600%	
VAR OBSERVADO (Promedio)				1.143%	

Cartera al 26/01/2023 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