

CARTERA SEMANAL
ST&ER-5
29 FEBRERO 2024



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE		17,132	0.002%
IS BPA182 240307	mxAAA	17,132	0.002%
INVERSION EN DOLARES		968,263,722	99.998%
CHD BACOM 4746900		34,125	0.004%
CHD BSCTIA 2157000		947,414,755	97.845%
CHD JPMOR 3584000		20,814,842	2.150%
TOTAL CARTERA		968,280,853	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		967,619,715	
VAR ESTABLECIDO			2.600%
VAR OBSERVADO (Promedio)			1.247%

Cartera al 29/02/2024 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