

CARTERA SEMANAL
ST&ERP
29 FEBRERO 2024



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
PRLV		16,771,181,253	100.000%
I BACMEXT 24095	mxA-1+	3,837,898,825	22.884%
I BANOBR 24095	mxA-1+	2,903,958,525	17.315%
I NAFIN 24095	mxA-1+	8,029,323,903	47.876%
I SHF 24095	F1+(mex)	2,000,000,000	11.925%
TOTAL CARTERA		16,771,181,253	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		16,747,193,724	
VAR ESTABLECIDO			0.025%
VAR OBSERVADO (Promedio)			0.001%

Cartera al 29/02/2024 Fondo SAM Deuda Corto Plazo 5, 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
Calificación:	
Escala homogénea	AAA/1S&P

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