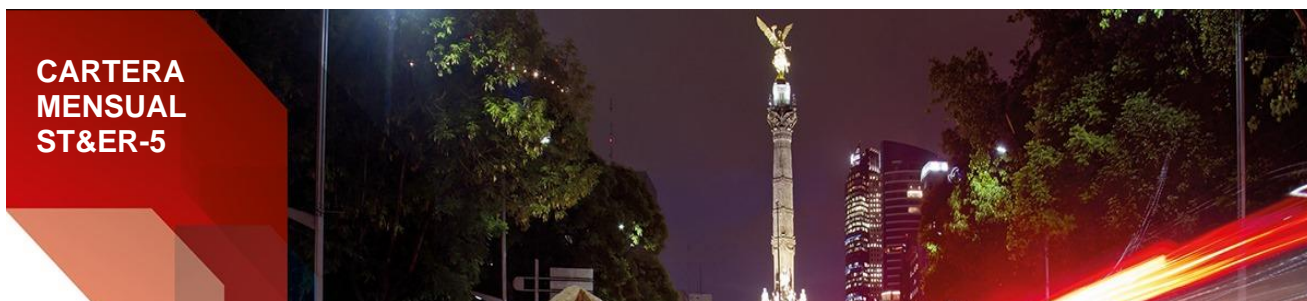


CARTERA MENSUAL
ST&ER-5
MAYO 2023



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE		17,534,186	0.914%
LF BONDESF 251204	mxAAA	17,534,186	0.914%
INVERSION EN DOLARES		1,900,827,313	99.086%
CHD BACOM 4746900		35,389	0.002%
CHD BSANT 2945000		78,057,219	4.069%
CHD JPMOR 3584000		1,822,734,705	95.015%
TOTAL CARTERA		1,918,361,499	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		1,914,540,920	
VAR ESTABLECIDO			2.600%
VAR OBSERVADO (Promedio)			1.163%

Cartera al 31/05/2023 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