

CARTERA MENSUAL  
ST&ER-5  
OCTUBRE 2024



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
<b>INVERSION EN DOLARES</b>		<b>1,153,286,606</b>	<b>100.000%</b>
CHD BSC2IA	2157000	88,474,378	7.671%
CHD JPMOR	3584000	1,064,812,228	92.329%
<b>TOTAL CARTERA</b>		<b>1,153,286,606</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>		<b>1,152,535,930</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>			<b>2.600%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>			<b>1.347%</b>

Cartera al 31/10/2024 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/SS&P

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