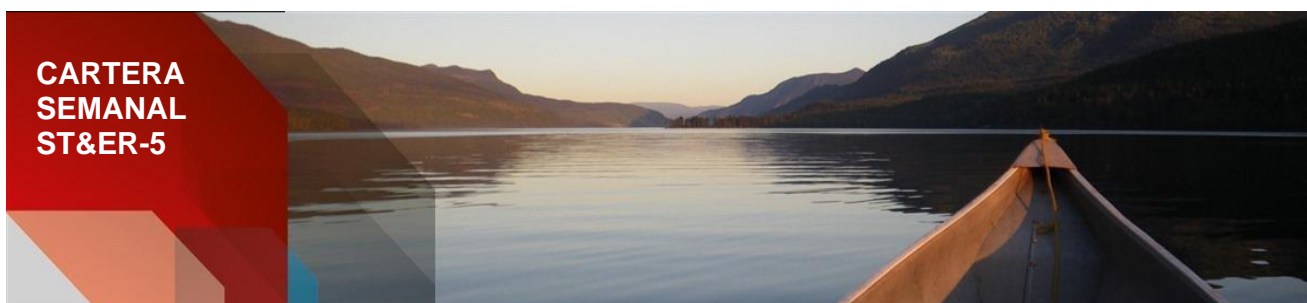


CARTERA SEMANAL
ST&ER-5
01 JUNIO 2023



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			17,647,379	0.927%
M	BONOS	290531 mxAAA	17,647,379	0.927%
INVERSION EN DOLARES			1,887,078,881	99.073%
CHD	BACOM	4746900	35,130	0.002%
CHD	BSANT	2945000	77,485,313	4.068%
CHD	JPMOR	3584000	1,809,558,438	95.004%
TOTAL CARTERA			1,904,726,260	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			1,901,147,552	
VAR ESTABLECIDO				2.600%
VAR OBSERVADO (Promedio)				1.162%

Cartera al 01/06/2023 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 homogenea AAA/6S&P

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