

CARTERA MENSUAL
RCOMP-5
 AGOSTO 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
		PRLV	1,829,343,857	100.000%
I	BACMEXT 19351	mxA-1+	8,251,328	0.451%
I	BACMEXT 20045	mxA-1+	1,821,092,529	99.549%
TOTAL CARTERA			1,829,343,857	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			1,824,234,650	
VAR ESTABLECIDO				0.208%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.048%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Deuda Recompensa 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.

Clasificación: Corto plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/2S&P

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