

CARTERA MENSUAL  
ST&ER5E  
JULIO 2018



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSÁTILIDAD	VALOR MERCADO	%
<b>TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE</b>		<b>469,476</b>	<b>0.858%</b>
S UDIBONO 201210	mxAAA	469,476	0.858%
<b>INVERSION EN EUROS</b>		<b>54,259,369</b>	<b>99.142%</b>
CHE BACOMER 3448908		50,755,738	92.740%
CHE JPMOR 9451060		3,503,630	6.402%
<b>TOTAL CARTERA</b>		<b>54,728,845</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>		<b>54,633,184</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>			<b>2.500%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>			<b>1.672%</b>

Cartera al 31/07/2018 FONDO SANTANDER S5, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION 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 en moneda extranjera

**Calificación:**

**Escala homogénea** AAA/BS&P

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