

CARTERA SEMANAL
RCOMP-3
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
		PRLV		1,821,306,921	100.000%
I	BACMEXT	19365	mxA-1+	5,057,429	0.278%
I	BANSAN	19475	MX-1	1,816,249,492	99.722%
TOTAL CARTERA				1,821,306,921	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,808,516,367	
VAR ESTABLECIDO					0.208%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.024%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Deuda Recompensa 3, 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

Calificación:

Escala homogénea AAA/2S&P

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