

CARTERA SEMANAL
RCOMP-5
 12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
		PRLV	1,834,027,095	100.000%
I	BACMEXT 19365	mxA-1+	8,215,194	0.448%
I	BACMEXT 20045	mxA-1+	1,825,811,901	99.552%
TOTAL CARTERA			1,834,027,095	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			1,827,247,556	
VAR ESTABLECIDO				0.208%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.042%

Cartera al 12/09/2019 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.

Categoría:	Corto plazo
Calificación:	
Escala homogénea	AAA/2S&P

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