

CARTERA MENSUAL  
ELITE-C  
AGOSTO 2019



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSÁTILIDAD	VALOR MERCADO	%
<b>TRACS EXTRANJEROS FIX</b>				
1I	FRMXX	N SIN BURSÁTILIDAD	35,940,300	3.033%
<b>TRACS EXTRANJEROS (SPOT)</b>				
1ISP	EEM	* SIN BURSÁTILIDAD	13,725,347	1.158%
<b>ACCIONES DE SI DEUDA</b>				
5I	DEUDAOP	F AAA/2	428,553,092	36.163%
5I	FONSER1	F AAA/2	530,274,823	44.746%
5I	ST&ER-7	F AAA/5	24,337,839	2.054%
<b>CEDES</b>				
F	HSBCMX	18012 mxA-1+	9,011,980	0.760%
<b>PRLV</b>				
I	BACMEX	20045 mxA-1+	48,408,150	4.085%
I	BANSAN	20114 MX-1	27,490,380	2.320%
I	BSCTIA	19504 mxA-1+	16,605,158	1.401%
I	BSCTIA	19512 mxA-1+	48,787,750	4.117%
<b>INVERSION EN DOLARES</b>				
CHD	BSANT	2945003	661,562	0.056%
<b>OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS</b>				
FD	VARIOS		71,064	0.006%
<b>APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS</b>				
AIM	VARIOS		750,400	0.063%
EAIM	VARIOS		450,167	0.038%
<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,185,068,011</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>			<b>1,158,237,385</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>				<b>1.100%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>				<b>0.075%</b>

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Balanceado 14, S.A. de C.V. F.I.R.V.

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.

<b>Clasificación:</b>	Discrecional
<b>Calificación:</b>	
<b>Escala homogénea</b>	NA

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

**Tenencia Indirecta en la cartera de DEUDAOP :**  
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	38,705,767	9.032%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	64,311,586	15.007%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	8,146,413	1.901%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	18,884,256	4.407%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	64,698,063	15.097%
CEDES	45,508,179	10.619%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	8,034,723	1.875%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	2,268,154	0.529%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	31,340,192	7.313%
INVERSION EN DOLARES	8,472	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-6,579	-0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-907,674	-0.212%
PRLV	47,591,854	11.105%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	5,211,318	1.216%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	59,646,018	13.918%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	34,421,305	8.032%
	692,361	0.162%
	-1,316	0.000%
<b>Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :</b>	<b>428,553,092</b>	<b>100.000%</b>

**Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :**  
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	9,772,387	1.843%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	136,247,993	25.894%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	40,496,785	7.637%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	21,154,323	3.989%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	105,292,117	19.856%
CEDES	67,785,177	12.783%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	5,010,907	0.945%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	196,559	0.037%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL	215,466	0.041%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	11,356,772	2.142%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-353,466	-0.067%
PRLV	55,543,121	10.474%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	3,142,058	0.593%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	60,748,284	11.456%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	13,260,148	2.501%
	406,191	0.077%
<b>Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :</b>	<b>530,274,823</b>	<b>100.000%</b>