

CARTERA MENSUAL
ELITE-C
MAYO 2019



| INSTRUMENTO | CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD | VALOR MERCADO | % |
|---|-----------------------------|----------------------|-----------------|
| SERVICIOS FINANCIEROS | | | |
| 1B NAFTRAC | ISHRS ALTA | 11,128,000 | 0.942% |
| TRACKS EXTRANJEROS (SPOT) | | | |
| 1ISP FRMKNX | N SIN BURSATILIDAD | 55,428,558 | 4.691% |
| 1ISP VARIOS | | 35,184,718 | 2.978% |
| ACCIONES DE SI DEUDA | | | |
| 51 DEUDAOP | F AAA/2 | 957,821,859 | 81.059% |
| 51 FONSER1 | F AAA/2 | 344,168,439 | 29.127% |
| 51 ST&ER-7 | F AAA/S | 562,941,247 | 47.641% |
| CEDES | | | |
| F HSBCMX | 18012 mxA-1+ | 8,995,918 | 0.761% |
| PRLV | | | |
| I BACMEXT | 19315 mxA-1+ | 140,051,125 | 11.852% |
| I BANSAN | 20114 MX-1 | 49,231,800 | 4.166% |
| I BSC7IA | 19504 mxA-1+ | 26,849,485 | 2.272% |
| I BSC7IA | 19512 mxA-1+ | 16,244,690 | 1.375% |
| I BSC7IA | 19512 mxA-1+ | 47,725,150 | 4.039% |
| INVERSION EN DOLARES | | | |
| CHD BSANT | 2945003 | 569,094 | 0.048% |
| OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS | | | |
| FD VARIOS | | -415,827 | -0.035% |
| APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS | | | |
| AIM VARIOS | | 8,054,472 | 0.682% |
| EAIM VARIOS | | 1,233,180 | 0.104% |
| EAIM VARIOS | | 6,821,292 | 0.577% |
| TOTAL CARTERA | | 1,181,633,198 | 100.000% |
| VALOR DEL ACTIVO NETO | | 1,179,052,707 | |
| VAR ESTABLECIDO | | | 1.100% |
| VAR OBSERVADO (Promedio) | | | 0.060% |

Cartera al 31/05/2019 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.

| | |
|------------------|--------------|
| Clasificación: | Discrecional |
| Calificación: | |
| Escala homogénea | 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 | 31,220,345 | 9.071% |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D | 20,728,812 | 6.023% |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS | 3,334,863 | 0.969% |
| BONOS DE PROTECCION AL AHORRO | 49,849,650 | 14.484% |
| BONOS DE PROTECCION AL AHORRO | 22,213,292 | 6.454% |
| CEDES | 39,721,284 | 11.541% |
| CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO | 6,492,312 | 1.886% |
| CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS | 33,394,128 | 9.703% |
| INVERSION EN DOLARES | 1,003 | 0.000% |
| OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS | 123,629 | 0.036% |
| OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS | 513,640 | 0.149% |
| PRLV | 37,399,100 | 10.867% |
| TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES | 3,405,221 | 0.989% |
| TITULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS | 410,561 | 0.119% |
| TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO | 57,202,747 | 16.621% |
| VALORES PARAESTATALES A RENDIM. | 37,424,267 | 10.874% |
| | -31,120 | -0.009% |
| | 764,707 | 0.222% |
| Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP : | 344,168,439 | 100.000% |

Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :
INSTRUMENTO

| INSTRUMENTO | VALOR MERCADO | % |
|--|--------------------|-----------------|
| BONOS | 7,254,646 | 1.289% |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D | 171,185,000 | 30.409% |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS | 5,093 | 0.001% |
| BONOS DE PROTECCION AL AHORRO | 42,201,899 | 7.497% |
| BONOS DE PROTECCION AL AHORRO | 37,693,567 | 6.696% |
| BONOS DE PROTECCION AL AHORRO | 119,334,311 | 21.198% |
| CEDES | 72,414,026 | 12.864% |
| CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO | 6,757,436 | 1.200% |
| CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL | 231,248 | 0.041% |
| CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS | 12,564,488 | 2.232% |
| OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV. | 0 | 0.000% |
| OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS | 126,552 | 0.022% |
| PRLV | 38,867,470 | 6.904% |
| TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES | 2,696,896 | 0.479% |
| TITULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS | 916,468 | 0.163% |
| TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO | 36,505,867 | 6.485% |
| VALORES PARAESTATALES A RENDIM. | 13,765,722 | 2.445% |
| | 420,558 | 0.075% |
| Total Tenencia Indirecta en FONSER1 : | 562,941,247 | 100.000% |