

**CARTERA MENSUAL
ELITE-D
AGOSTO 2019**



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACS EXTRANJEROS FIX				20,638,445	3.856%
11	FRMNX	N	SIN BURSATILIDAD	20,638,445	3.856%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				150,741,983	28.163%
11SP	EEM	*	SIN BURSATILIDAD	5,570,639	1.041%
11SP	GMF	*	SIN BURSATILIDAD	15,490,741	2.894%
11SP	UVV	*	SIN BURSATILIDAD	21,820,432	4.077%
11SP	USMV	*	SIN BURSATILIDAD	32,637,889	6.098%
11SP	VGK	*	SIN BURSATILIDAD	25,618,146	4.786%
11SP	VOO	*	SIN BURSATILIDAD	49,604,135	9.268%
ACCIONES DE SI DEUDA				181,130,708	33.841%
51	DEUDAOP	F	AAA/2	52,569,130	9.822%
51	FONSER1	F	AAA/2	50,046,085	9.380%
51	ST&ER-7	F	AAA/5	78,515,494	14.669%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE				132,786,303	24.809%
52	STER-GR	F	NA	45,878,402	8.572%
52	STER-OP	F	NA	86,907,901	16.237%
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)				15,188,620	2.838%
56SP	SANHYDI	LX	NA	15,188,620	2.838%
PLRV				14,587,868	2.725%
I	BANSAN	19355	MX-1	14,587,868	2.725%
INVERSION EN DOLARES				14,987,816	2.800%
CHD	BSANT	2945004		14,987,816	2.800%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE INDICES				-133,770	-0.025%
FI	IPC	SP19		-133,770	-0.025%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				200,502	0.037%
FD	VARIOS			200,502	0.037%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				5,112,886	0.955%
AIM	VARIOS			2,780,800	0.520%
EAIM	VARIOS			2,332,086	0.436%
TOTAL CARTERA				535,241,362	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				535,417,860	
VAR ESTABLECIDO					2.900%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.667%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Balanceado 15, 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 cotas. 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 ST&ER-7 :		VALOR MERCADO	%
INSTRUMENTO			
BONOS		45,124,790	57.472%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS		3,542,003	4.511%
CEDES		1,900,613	2.421%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO		586,358	0.747%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS		6,056,796	7.714%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA		5,155,383	6.566%
INVERSION EN DOLARES		974	0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS		-4,281	-0.005%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS		-312,083	-0.397%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE		561,424	0.715%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.		15,332,495	19.528%
		-469	-0.001%
		571,491	0.728%
Total Tenencia Indirecta en ST&ER-7 :		78,515,494	100.000%
Tenencia Indirecta en la cartera de STER-OP :		VALOR MERCADO	%
INSTRUMENTO			
ENERGIA		1,478,902	1.702%
INDUSTRIAL		16,117,112	18.545%
MATERIALES		12,164,915	13.997%
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE		20,899,269	24.048%
SALUD		2,928,581	3.370%
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES		2,117,201	2.436%
SERVICIOS FINANCIEROS		21,671,977	24.937%
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO		6,368,628	7.328%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE		3,161,317	3.638%
Total Tenencia Indirecta en STER-OP :		86,907,901	100.000%