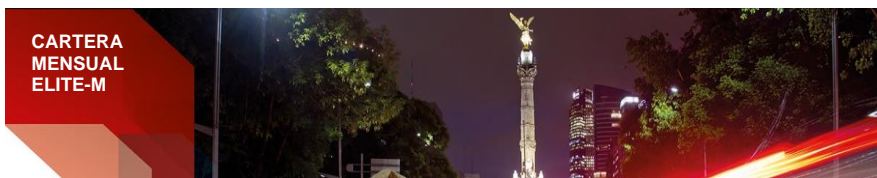


**CARTERA MENSUAL
ELITE-M
MAYO 2019**



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSÁTILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)			
1SP FRMKNX	N	261,982,510	18.889%
1SP IVV	SIN BURSÁTILIDAD	28,414,325	2.049%
1SP VARIO	SIN BURSÁTILIDAD	55,578,956	4.007%
1SP VOO	SIN BURSÁTILIDAD	80,227,004	5.842%
1SP VOO	SIN BURSÁTILIDAD	117,762,224	8.615%
ACCIONES DE SI DEUDA			
51 DEUDAOP	F	642,095,491	46.360%
51 FONSER1	F	244,822,154	17.62%
51 STAER-7	F	92,148,203	6.644%
51 STAER-7	F	306,025,094	22.064%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE			
52 STER-GR	F	227,407,026	16.396%
52 STER-OP	F	82,893,232	5.977%
52 STER-OP	F	145,513,794	10.419%
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)			
56SP GSECSAI	LX	73,063,882	5.268%
56SP SANHYDI	LX	41,222,580	3.188%
56SP SANHYDI	LX	28,841,502	2.079%
CEDES			
F HSBCMX	18012	11,950,041	0.862%
F HSBCMX	18012	11,950,041	0.862%
PRLV			
I BANISAN	19395	143,805,144	10.368%
I BANISAN	20114	35,020,017	2.523%
I BANISAN	20114	33,189,469	2.393%
I BSCTW	19512	75,596,638	5.451%
INVERSION EN DOLARES			
CHD BSANT	2945005	2,836,862	0.205%
CHD BSANT	2945005	2,836,862	0.205%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE INDICES			
FI VARIOS		1,018,300	0.073%
FI VARIOS		1,018,300	0.073%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS			
FD VARIOS		-1,223,012	-0.888%
FD VARIOS		-1,223,012	-0.888%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			
AM VARIOS		23,139,620	1.669%
EAM VARIOS		3,130,880	0.223%
EAM VARIOS		13,939,740	1.005%
TOTAL CARTERA		1,386,966,835	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		1,370,333,232	
VAR ESTABLECIDO			2.100%
VAR OBSERVADO (Promedio)			0.450%

Cartera al 31/05/2019 Fondo SAM Balanceado 16, S.A. de C.V. F.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	VALOR MERCADO	%
BONOS	22,208,406	9.071%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	14,745,316	6.023%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	2,372,235	0.969%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	15,801,293	6.454%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	35,460,251	14.484%
CEDES	28,255,498	11.541%
CERTIFICADO BURSÁTIL BANCARIO	4,618,267	1.869%
CERTIFICADO BURSÁTIL DE EMPRESAS PRIVADAS	23,754,713	9.370%
INVERSION EN DOLARES	713	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	87,943	0.036%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	365,375	0.140%
PRLV	26,603,626	10.867%
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	2,422,284	0.989%
TÍTULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS	292,050	0.119%
TÍTULOS RECIBIDOS EN REPORTE	40,680,833	16.621%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	26,821,529	10.874%
	-22,137	-0.009%
	543,970	0.222%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	244,822,164	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de ST&ER-7 :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	164,776,673	53.844%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	2,920,467	0.954%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	6,640,985	2.170%
CERTIFICADO BURSÁTIL BANCARIO	2,388,841	0.781%
CERTIFICADO BURSÁTIL DE EMPRESAS PRIVADAS	21,470,262	7.016%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE INDEMNIZACIÓN CARRETERA	16,100,862	5.281%
INVERSION EN DOLARES	2,969	0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	119,498	0.039%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-51,817	-0.017%
PRLV	2,896,769	0.947%
TÍTULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS	379,695	0.124%
TÍTULOS RECIBIDOS EN REPORTE	37,925,573	12.893%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	46,776,564	15.939%
	-45,085	-0.015%
	1,722,839	0.563%
Total Tenencia Indirecta en ST&ER-7 :	306,025,094	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de STER-OP :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
ENERGIA	5,569,331	3.854%
INDUSTRIAL	24,619,442	17.038%
MATERIALES	24,191,512	16.740%
PRESTAMO DE VALORES	29,638	0.020%
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE	33,205,634	22.977%
SAUD	4,859,730	3.363%
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES	6,173,510	5.650%
SERVICIOS FINANCIEROS	32,382,883	22.408%
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO	10,759,677	7.445%
TÍTULOS RECIBIDOS EN REPORTE	723,439	0.501%
Total Tenencia Indirecta en STER-OP :	144,513,794	100.000%