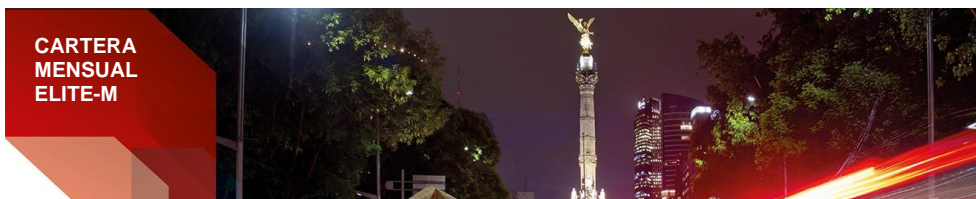


**CARTERA MENSUAL
ELITE-M
AGOSTO 2019**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACS EXTRANJEROS FIX				
11	FRMKNX	N	29,024,515	2.266%
		SIN BURSATILIDAD	29,024,515	2.266%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				
			224,068,052	17.494%
1ISP	USMV	*	53,785,219	4.199%
1ISP	VIARIOS	*	32,394,195	2.529%
1ISP	VGK	*	26,144,835	2.041%
1ISP	VOO	*	111,743,805	8.724%
		SIN BURSATILIDAD		
ACCIONES DE SI DEUDA				
			628,742,965	49.089%
51	DEUDAOP	F	329,706,809	25.742%
51	FONSEKT	F	109,144,357	8.521%
51	ST&ER-7	F	189,891,799	14.826%
		AAA/2		
		AAA/2		
		AAA/5		
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE				
			181,906,454	14.202%
52	STER-GR	F	83,301,036	6.504%
52	STER-OP	F	98,605,418	7.699%
		NA		
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)				
			29,387,505	2.294%
56SP	SANHYDI	LX	29,387,505	2.294%
		NA		
CEDES				
			11,971,377	0.935%
F	HSCMX	18012	11,971,377	0.935%
		mxA-1+		
PRLV				
			147,023,695	11.479%
I	BANSAN	19355	35,763,203	2.792%
I	BANSAN	20114	33,980,695	2.653%
I	BSCTIA	19512	77,279,796	6.034%
		mxA-1+		
INVERSION EN DOLARES				
			19,350,838	1.511%
CHD	BSANT	2945005	19,350,838	1.511%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE INDICES				
			-261,170	-0.020%
F1	IPC	SP19	-261,170	-0.020%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				
			211,923	0.017%
FD	VIARIOS		211,923	0.017%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				
			9,400,019	0.734%
AIM	VIARIOS		3,533,400	0.276%
EAIM	VIARIOS		5,866,619	0.458%
TOTAL CARTERA			1,280,826,173	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			1,276,544,008	
VAR ESTABLECIDO				2.100%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.382%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Balanceado 16, 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	VALOR MERCADO	%
BONOS	29,778,236	9.032%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	49,478,042	15.007%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	6,267,433	1.901%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	14,528,580	4.407%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	49,775,377	15.097%
CEDES	35,011,663	10.619%
CERTIFICADO BURSÁTIL BANCARIO	6,181,505	1.875%
CERTIFICADO BURSÁTIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	1,745,001	0.529%
CERTIFICADO BURSÁTIL DE EMPRESAS PRIVADAS	24,111,539	7.313%
INVERSION EN DOLARES	6,518	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-5,062	-0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-698,318	-0.212%
PRLV	36,614,736	11.105%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	4,009,321	1.216%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	45,888,592	13.918%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	26,481,990	8.032%
	532,667	0.162%
	-1,012	0.000%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	329,706,809	100.000%

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

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	109,135,498	57.472%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	8,566,427	4.511%
CEDES	4,596,683	2.421%
CERTIFICADO BURSÁTIL BANCARIO	1,418,122	0.747%
CERTIFICADO BURSÁTIL DE EMPRESAS PRIVADAS	14,648,522	7.714%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	12,468,431	6.566%
INVERSION EN DOLARES	2,355	0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-10,353	-0.005%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-754,782	-0.397%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	1,357,819	0.715%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	37,082,046	19.528%
	-1,135	-0.001%
	1,382,166	0.728%
Total Tenencia Indirecta en ST&ER-7 :	189,891,799	100.000%