

**CARTERA MENSUAL
SAM-AF
AGOSTO 2019**



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
ACCIONES DE SI DEUDA			831,087,267	30.658%
51	FONSER1	F AAA/2	88,827,663	3.277%
51	STEREAL	F AAA/6	132,625,921	4.892%
51	ST&ER-4	F AAA/2	207,459,660	7.653%
51	ST&ER-7	F AAA/5	402,174,023	14.836%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE			1,879,469,604	69.331%
52	SMALTA1	M NA	939,874,020	34.671%
52	SMALTA2	M NA	939,595,584	34.661%
BONOS			290,196	0.011%
M	BONOS	260305 mxAAA	290,196	0.011%
INVERSION EN DOLARES			4,029	0.000%
CHD	BSANT	2945063	4,029	0.000%
TOTAL CARTERA			2,710,851,096	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			2,709,544,754	
VAR ESTABLECIDO				2.750%
VAR OBSERVADO (Promedio)				1.064%

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Balanceado 9, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable

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 SMALTA2 :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
INVERSION EN DOLARES	11,328,928	1.206%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	1,552,481	0.165%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)	926,714,174	98.629%
Total Tenencia Indirecta en SMALTA2 :	939,595,584	100.000%

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

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	231,139,325	57.472%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	18,142,935	4.511%
CEDES	9,735,367	2.421%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	3,003,456	0.747%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	31,024,272	7.714%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	26,407,033	6.566%
INVERSION EN DOLARES	4,989	0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-21,927	-0.005%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-1,598,561	-0.397%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	2,875,741	0.715%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	78,536,491	19.528%
	-2,403	-0.001%
	2,927,305	0.728%
Total Tenencia Indirecta en ST&ER-7 :	402,174,023	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de SMALTA1 :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
ENERGIA	14,430,157	1.535%
INDUSTRIAL	168,014,554	17.876%
MATERIALES	125,382,634	13.340%
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE	203,234,335	21.624%
SALUD	28,765,525	3.061%
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES	25,454,259	2.708%
SERVICIOS FINANCIEROS	210,809,978	22.430%
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO	46,237,920	4.920%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	117,544,660	12.506%
Total Tenencia Indirecta en SMALTA1 :	939,874,020	100.000%