



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				114,799,025	8.351%
LD	BONDES	230504	mxAAA	57,399,527	4.176%
M	BONOS	270603	mxAAA	25,275,728	1.839%
M	BONOS	270603	mxAAA	32,123,769	2.337%
SERVICIOS PUBLICOS				1,363,493	0.099%
FF	FVIA	16	MINIMA	1,363,493	0.099%
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES				14,897,356	1.084%
1	VARIOS			14,897,356	1.084%
SERVICIOS FINANCIEROS				120,311,900	8.752%
CF	VARIOS			55,059,787	4.005%
FH	VARIOS			1,681,365	0.122%
0	VARIOS			11,911,480	0.867%
1	GFNORTE	O	ALTA	41,410,961	3.012%
1	VARIOS			8,558,250	0.623%
41	VARIOS			1,690,057	0.123%
SALUD				6,480,337	0.471%
1	FRAGUA	B	BAJA	6,480,337	0.471%
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE				68,210,258	4.962%
1	VARIOS			40,625,834	2.955%
1	WALMEX	*	ALTA	27,584,424	2.007%
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				19,875,235	1.446%
1	VARIOS			19,875,235	1.446%
INDUSTRIAL				41,022,250	2.984%
CF	VARIOS			299,672	0.022%
1	VARIOS			40,722,578	2.962%
MATERIALES				46,387,147	3.374%
1	VARIOS			46,387,147	3.374%
ENERGIA				11,141,836	0.811%
1	IENOVA	*	ALTA	11,141,836	0.811%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				415,513,313	30.227%
1ISP	FEZ	*	SIN BURSATILIDAD	30,805,698	2.241%
1ISP	IVV	*	SIN BURSATILIDAD	56,232,826	4.091%
1ISP	SPY	*	SIN BURSATILIDAD	83,839,934	6.099%
1ISP	VARIOS			98,898,613	7.194%
1ISP	VOO	*	SIN BURSATILIDAD	72,545,505	5.277%
1ISP	VT	*	SIN BURSATILIDAD	34,132,584	2.483%
1ISP	VWQ	*	SIN BURSATILIDAD	39,058,153	2.841%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE				127,816,865	9.298%
52	STER-OP	ED	NA	127,816,865	9.298%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				1,667,561	0.121%
91	FUNO	15	AAA(mex)	1,667,561	0.121%
BONOS				188,969,397	13.747%
M	VARIOS			188,969,397	13.747%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				195,338,919	14.210%
S	UDIBONO	251204	mxAAA	30,794,378	2.240%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	32,998,823	2.401%
S	UDIBONO	461108	mxAAA	28,563,885	2.078%
S	VARIOS			102,981,833	7.492%
INVERSION EN DOLARES				848,159	0.062%
CHD	BSANT	2945048		848,159	0.062%
TOTAL CARTERA				1,374,643,053	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,346,308,728	
VAR ESTABLECIDO					2.200%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.877%

Cartera al 31/05/2019 Fondo SAM Balanceado 11, 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: Mayoritariamente renta variable

Calificación:

Escala homogénea NA

El Fondo de inversión NO se encuentra en una estrategia temporal de inversión