



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
<b>TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE</b>				<b>198,264,865</b>	<b>6.971%</b>
LD	BONDES	230831	mxAAA	99,132,590	3.486%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	99,132,275	3.486%
<b>SERVICIOS PUBLICOS</b>				<b>2,286,945</b>	<b>0.080%</b>
FF	FVIA	16	MINIMA	2,286,945	0.080%
<b>SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>				<b>27,025,701</b>	<b>0.950%</b>
1	VARIOS			27,025,701	0.950%
<b>SERVICIOS FINANCIEROS</b>				<b>225,202,746</b>	<b>7.918%</b>
CF	VARIOS			112,145,378	3.943%
FH	VARIOS			1,289,450	0.045%
0	VARIOS			16,176,314	0.569%
1	GFNORTE	0	ALTA	71,859,335	2.527%
1	VARIOS			21,144,721	0.743%
41	VARIOS			2,587,548	0.091%
<b>SALUD</b>				<b>9,504,000</b>	<b>0.334%</b>
1	FRAGUA	B	BAJA	9,504,000	0.334%
<b>PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>				<b>114,028,451</b>	<b>4.009%</b>
1	VARIOS			114,028,451	4.009%
<b>SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO</b>				<b>34,878,070</b>	<b>1.226%</b>
1	VARIOS			34,878,070	1.226%
<b>INDUSTRIAL</b>				<b>77,773,683</b>	<b>2.735%</b>
CF	VARIOS			903,531	0.032%
1	VARIOS			76,870,152	2.703%
<b>MATERIALES</b>				<b>73,174,350</b>	<b>2.573%</b>
1	VARIOS			73,174,350	2.573%
<b>ENERGIA</b>				<b>8,094,804</b>	<b>0.285%</b>
1	IENOVA	*	ALTA	8,094,804	0.285%
<b>TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)</b>				<b>680,881,099</b>	<b>23.940%</b>
1ISP	FEZ	*	SIN BURSATILIDAD	63,296,643	2.226%
1ISP	IVV	*	SIN BURSATILIDAD	68,490,931	2.408%
1ISP	SPY	*	SIN BURSATILIDAD	134,201,591	4.719%
1ISP	USMV	*	SIN BURSATILIDAD	82,717,217	2.908%
1ISP	VARIOS	*	SIN BURSATILIDAD	141,124,732	4.962%
1ISP	VGO	*	SIN BURSATILIDAD	116,424,455	4.094%
1ISP	VWO	*	SIN BURSATILIDAD	74,625,531	2.624%
<b>ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE</b>				<b>144,386,865</b>	<b>5.077%</b>
52	STER-OP	ED	NA	144,386,865	5.077%
<b>CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS</b>				<b>3,920,977</b>	<b>0.138%</b>
91	FUNO	15	AAA(mex)	3,920,977	0.138%
<b>BONOS</b>				<b>622,688,976</b>	<b>21.894%</b>
M	VARIOS			622,688,976	21.894%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS</b>				<b>620,511,932</b>	<b>21.817%</b>
S	UDIBONO	201210	mxAAA	66,010,406	2.321%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	106,276,215	3.737%
S	UDIBONO	251204	mxAAA	117,581,057	4.134%
S	UDIBONO	351122	mxAAA	61,988,391	2.180%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	109,607,061	3.854%
S	UDIBONO	461108	mxAAA	99,502,489	3.499%
S	VARIOS			59,546,314	2.094%
<b>INVERSION EN DOLARES</b>				<b>1,484,342</b>	<b>0.052%</b>
CHD	BSANT	2945049		1,484,342	0.052%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>2,844,107,806</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>				<b>2,849,085,137</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>					<b>2.000%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>					<b>0.694%</b>

Cartera al 30/08/2019 Fondo SAM Balanceado 12, 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