

**CARTERA SEMANAL
ELITE-C**
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACKS EXTRANJEROS FIX				36,055,800	3.157%
1I	FRMXNX	N	SIN BURSATILIDAD	36,055,800	3.157%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				13,902,723	1.217%
1ISP	EEM	*	SIN BURSATILIDAD	13,902,723	1.217%
ACCIONES DE SI DEUDA				934,564,562	81.836%
51	DEUDAOP	F	AAA/2	429,014,932	37.567%
51	FONSER1	F	AAA/2	481,307,215	42.146%
51	ST&ER-7	F	AAA/5	24,242,415	2.123%
CEDES				8,975,137	0.786%
F	HSBCMX	18012	mxA-1+	8,975,137	0.786%
PRLV				141,657,309	12.404%
I	BACMEXT	20045	mxA-1+	48,533,600	4.250%
I	BANSAN	20114	MX-1	27,561,676	2.413%
I	BSCTIA	19504	mxA-1+	16,648,083	1.458%
I	BSCTIA	19512	mxA-1+	48,913,950	4.283%
INVERSION EN DOLARES				39,407	0.003%
CHD	BSANT	2945003		39,407	0.003%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				5,395,313	0.472%
95	PEMEX	13-2	Aa3.mx	5,395,313	0.472%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				59,640	0.005%
FD	DEUA	DC19		59,640	0.005%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				1,345,761	0.118%
AIM	VARIOS			536,000	0.047%
EAIM	VARIOS			809,761	0.071%
TOTAL CARTERA				1,141,995,653	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				1,141,319,005	
VAR ESTABLECIDO					1.100%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.075%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Balanceado 14, 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.

Categoría:	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

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	37,129,113	8.655%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	60,794,624	14.171%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	5,883,489	1.371%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	62,815,690	14.642%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	18,398,254	4.288%
CEDES	46,996,210	10.954%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	7,812,250	1.821%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	1,086,884	0.253%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	30,353,191	7.075%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	3,170,788	0.739%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	9,950,133	2.319%
INVERSION EN DOLARES	7,981	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-838	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-892,163	-0.208%
PRLV	46,371,966	10.809%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	5,081,974	1.185%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	57,758,677	13.463%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	35,629,505	8.305%
	-7,281	-0.002%
	674,685	0.157%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	429,014,932	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	11,499,944	2.389%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	114,854,626	23.863%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	95,233,206	19.786%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	19,251,082	4.000%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	36,855,751	7.657%
CEDES	59,150,708	12.290%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	4,543,087	0.944%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	178,892	0.037%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL	196,105	0.041%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	10,295,829	2.139%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	8,806,131	1.830%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-332,351	-0.069%
PRLV	42,101,871	8.747%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	2,858,936	0.594%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	63,390,982	13.171%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	12,052,678	2.504%
	369,737	0.077%
Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :	481,307,215	100.000%