

CARTERA SEMANAL ELITE-D
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSÁTILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACS EXTRANJEROS FIX			
11 FRMNX N	SIN BURSÁTILIDAD	20,704,770	3.886%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)			
1ISP EEM *	SIN BURSÁTILIDAD	149,977,415	28.149%
1ISP GMF *	SIN BURSÁTILIDAD	5,642,630	1.059%
1ISP IVV *	SIN BURSÁTILIDAD	15,538,687	2.916%
1ISP USMV *	SIN BURSÁTILIDAD	21,783,111	4.088%
1ISP VGK *	SIN BURSÁTILIDAD	31,816,074	5.971%
1ISP VOO *	SIN BURSÁTILIDAD	25,676,096	4.819%
1ISP VOO *	SIN BURSÁTILIDAD	49,520,818	9.294%
ACCIONES DE SI DEUDA			
51 DEUDAOP F	AAA2	189,498,271	35.566%
51 FONSER1 F	AAA2	52,625,782	9.877%
51 ST&ER-7 F	AAA5	58,664,838	11.011%
51 ST&ER-7 F	AAA5	78,207,651	14.678%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE			
52 STER-GR F	NA	130,706,506	24.532%
52 STER-OP F	NA	46,424,646	8.713%
52 STER-OP F	NA	84,281,860	15.818%
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)			
56SP SANHYDI LX	NA	14,876,070	2.792%
56SP SANHYDI LX	NA	14,876,070	2.792%
CEDES			
F BANSAN 19030	MX-1	21,896,037	4.110%
F BANSAN 19035	MX-1	13,732,134	2.577%
F BANSAN 19035	MX-1	8,163,903	1.532%
INVERSION EN DOLARES			
CHD BSANT 2945004		25,111	0.005%
CHD BSANT 2945004		25,111	0.005%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE INDICES			
FI IPC SP19		10,710	0.002%
FI IPC SP19		10,710	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS			
FD DEUA DC19		52,185	0.010%
FD DEUA DC19		52,185	0.010%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			
AIM VARIOS		5,060,000	0.950%
AIM VARIOS		1,132,600	0.213%
EAIM VARIOS		3,927,400	0.737%
EAIM VARIOS		3,927,400	0.737%
TOTAL CARTERA		532,807,076	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO		532,451,445	
VAR ESTABLECIDO			2.900%
VAR OBSERVADO (Promedio)			0.640%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Balanceado 15, 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 FONSER1 :
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	1,401,688	2.389%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	13,999,225	23.863%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	2,346,446	4.000%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	4,492,218	7.657%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	11,607,639	19.786%
CEDES	7,209,671	12.290%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	553,741	0.944%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	21,804	0.037%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL	23,903	0.041%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	1,254,922	2.139%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	1,073,348	1.830%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-40,509	-0.069%
PRLV	5,131,648	8.747%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	348,466	0.594%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	7,726,503	13.171%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	1,469,058	2.504%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	45,066	0.077%
Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :	58,664,838	100.000%

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

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	40,939,566	52.347%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	2,993,652	3.828%
CEDES	1,879,851	2.404%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	577,821	0.739%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	5,937,839	7.592%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	6,806,480	8.447%
INVERSION EN DOLARES	931	0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-415	-0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-309,382	-0.396%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	3,879,356	4.960%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	15,139,264	19.358%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	565,324	0.723%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	-2,636	-0.003%
Total Tenencia Indirecta en ST&ER-7 :	78,207,651	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de STER-OP :
INSTRUMENTO

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
ENERGIA	1,365,417	1.620%
INDUSTRIAL	16,060,168	19.055%
MATERIALES	12,341,107	14.643%
PRESTAMO DE VALORES	291,878	0.346%
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE	21,658,986	25.580%
SALUD	2,865,670	3.400%
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES	2,030,245	2.409%
SERVICIOS FINANCIEROS	21,099,353	25.034%
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO	6,537,433	7.757%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	131,604	0.156%
Total Tenencia Indirecta en STER-OP :	84,281,860	100.000%