

CARTERA SEMANAL ELITE-M
12 SEPTIEMBRE 2019



INSTRUMENTO	CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD		VALOR MERCADO	%	
TRACKS EXTRANJEROS FIX			29,117,790	2.287%	
11	FRMXNX	N	SIN BURSATILIDAD	29,117,790	2.287%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)			222,803,827	17.502%	
1ISP	USMV	*	SIN BURSATILIDAD	52,430,918	4.119%
1ISP	VARIOS			32,612,818	2.562%
1ISP	VGK	*	SIN BURSATILIDAD	26,203,976	2.058%
1ISP	VOO	*	SIN BURSATILIDAD	111,556,115	8.763%
ACCIONES DE SI DEUDA			633,993,845	49.803%	
51	DEUDAOP	F	AAA/2	330,062,125	25.928%
51	FONSER1	F	AAA/2	114,784,448	9.017%
51	ST&ER-7	F	AAA/5	189,147,273	14.858%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE			184,013,069	14.455%	
52	STER-GR	F	NA	84,292,847	6.622%
52	STER-OP	F	NA	99,720,222	7.833%
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)			28,782,771	2.261%	
56SP	SANHYDI	LX	NA	28,782,771	2.261%
CEDES			53,729,595	4.221%	
F	BANSAN	19030	MX-1	26,219,327	2.060%
F	VARIOS			27,510,268	2.161%
PRLV			111,548,521	8.763%	
I	BANSAN	20114	MX-1	34,068,824	2.676%
I	BSCTIA	19512	mxA-1+	77,479,697	6.086%
INVERSION EN DOLARES			41,257	0.003%	
CHD	BSANT	2945005		41,257	0.003%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE INDICES			26,010	0.002%	
FI	IPC	SP19		26,010	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS			99,897	0.008%	
FD	DEUA	DC19		99,897	0.008%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS			8,843,144	0.695%	
AIM	VARIOS			2,509,400	0.197%
EAIM	VARIOS			6,333,744	0.498%
TOTAL CARTERA			1,272,999,726	100.000%	
VALOR DEL ACTIVO NETO			1,271,825,099		
VAR ESTABLECIDO				2.100%	
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.386%	

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Balanceado 16, 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	VALOR MERCADO	%
BONOS	28,565,238	8.655%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	46,772,194	14.171%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	4,526,455	1.371%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	48,327,099	14.642%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	14,154,675	4.288%
CEDES	36,156,478	10.954%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	6,010,345	1.821%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	836,193	0.253%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	23,352,191	7.075%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	2,439,442	0.739%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	7,655,123	2.319%
INVERSION EN DOLARES	6,140	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-645	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-686,384	-0.208%
PRLV	35,676,217	10.809%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	3,909,811	1.185%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	44,436,569	13.463%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	27,411,517	8.305%
	-5,601	-0.002%
	519,068	0.157%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	330,062,125	100.000%

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

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	99,013,423	52.347%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	7,240,226	3.828%
CEDES	4,546,469	2.404%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	1,397,475	0.739%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	14,360,820	7.592%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	15,977,947	8.447%
INVERSION EN DOLARES	2,253	0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-1,003	-0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-748,249	-0.396%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	9,382,326	4.960%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	36,614,711	19.358%
	-6,375	-0.003%
	1,367,252	0.723%
Total Tenencia Indirecta en ST&ER-7 :	189,147,273	100.000%