



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TRACS EXTRANJEROS FIX				
11	FRMXX	N	38,077,110	4.169%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				
			263,182,220	28.812%
11SP	EEM	*	10,045,839	1.100%
11SP	GMF	*	23,801,174	2.608%
11SP	IVV	*	38,794,179	4.247%
11SP	USMV	*	56,576,295	6.194%
11SP	VGK	*	47,920,970	5.248%
11SP	VGO	*	86,043,763	9.420%
ACCIONES DE SI DEUDA				
			333,165,846	36.474%
51	DEUDOP	F	93,910,526	10.281%
51	FONSER1	F	99,643,354	10.909%
51	ST&ER-7	F	139,611,965	15.284%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE				
			213,229,311	23.343%
52	STER-GR	F	67,449,309	7.384%
52	STER-OP	F	145,779,402	15.959%
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)				
			23,451,248	2.567%
56SP	SANNYDI	LX	23,451,248	2.567%
CEDES				
			34,022,951	3.725%
F	BANSAN	19030	21,337,508	2.336%
F	BANSAN	19035	12,685,443	1.389%
INVERSION EN DOLARES				
			42,059	0.005%
CHD	BSANT	2945018	42,059	0.005%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE INDICES				
			3,060	0.000%
FI	IPC	SP19	3,060	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS				
			105,861	0.012%
FD	DEUA	DC19	105,861	0.012%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				
			8,185,137	0.894%
AIM	VARIOS		1,141,000	0.125%
EAM	VARIOS		7,024,137	0.769%
TOTAL CARTERA			913,444,803	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO			910,950,275	
VAR ESTABLECIDO				2.900%
VAR OBSERVADO (Promedio)				0.664%

Cartera al 12/09/2019 Fondo SAM Balanceado 5, 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	8,127,490	8.655%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	13,307,802	14.171%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	1,287,884	1.371%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	13,750,209	14.642%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	4,027,342	4.288%
CEDES	10,287,378	10.954%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	1,710,086	1.821%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	237,917	0.253%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	6,644,254	7.075%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	694,079	0.739%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	2,178,065	2.319%
INVERSION EN DOLARES	1,747	0.002%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-183	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-195,293	-0.209%
PRLV	10,150,732	10.800%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	1,112,434	1.185%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	12,643,261	13.463%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	7,799,229	8.305%
	-1,594	-0.002%
	147,687	0.157%
Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :	93,910,526	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	2,380,793	2.389%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	23,777,953	23.863%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	19,715,798	19.786%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	3,985,484	4.000%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	7,630,118	7.657%
CEDES	12,245,765	12.290%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	940,539	0.944%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	37,035	0.037%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL	40,599	0.041%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	2,131,510	2.139%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	1,823,103	1.830%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-68,805	-0.069%
PRLV	8,716,203	8.747%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	591,876	0.594%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	13,123,614	13.171%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	2,495,224	2.504%
	76,545	0.077%
Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :	99,643,354	100.000%

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

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	73,083,045	52.347%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	5,344,101	3.828%
CEDES	3,355,805	2.404%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	1,031,494	0.739%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	10,599,901	7.592%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	11,793,522	8.447%
INVERSION EN DOLARES	1,663	0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - FUTUROS SOBRE DIVISAS	-741	-0.001%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	-552,292	-0.398%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	6,925,212	4.960%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	27,025,776	19.358%
	-4,706	-0.003%
	1,009,186	0.723%
Total Tenencia Indirecta en ST&ER-7 :	139,611,965	100.000%

Tenencia Indirecta en la cartera de STER-OP :

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
ENERGIA	2,361,714	1.620%
INDUSTRIAL	27,778,713	19.055%
MATERIALES	21,345,983	14.643%
PRESTAMO DE VALORES	504,851	0.346%
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE	37,289,828	25.580%
SALUD	4,956,650	3.400%
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES	3,511,643	2.409%
SERVICIOS FINANCIEROS	36,494,817	25.034%
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO	11,307,570	7.757%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE	227,631	0.156%
Total Tenencia Indirecta en STER-OP :	145,779,402	100.000%