



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE				231,365,279	8.002%
LD	BONDES	221110	mxAAA	115,682,865	4.001%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	115,682,414	4.001%
SERVICIOS PUBLICOS				2,286,945	0.079%
FF	FVIA	16	MINIMA	2,286,945	0.079%
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES				27,125,600	0.938%
1	VARIOS			27,125,600	0.938%
SERVICIOS FINANCIEROS				230,631,651	7.977%
CF	VARIOS			115,751,175	4.003%
FH	VARIOS			1,316,633	0.046%
0	VARIOS			16,559,942	0.573%
1	GFNORTE	0	ALTA	72,165,913	2.496%
1	VARIOS			22,288,029	0.771%
41	VARIOS			2,549,959	0.088%
SALUD				9,504,000	0.329%
1	FRAGUA	B	BAJA	9,504,000	0.329%
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE				119,390,513	4.129%
1	VARIOS			119,390,513	4.129%
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				36,273,209	1.255%
1	VARIOS			36,273,209	1.255%
INDUSTRIAL				102,086,471	3.531%
CF	VARIOS			933,267	0.032%
1	VARIOS			101,153,204	3.499%
MATERIALES				51,595,945	1.785%
1	VARIOS			51,595,945	1.785%
ENERGIA				7,345,966	0.254%
1	IENOVA	*	ALTA	7,345,966	0.254%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				680,485,886	23.536%
1ISP	FEZ	*	SIN BURSATILIDAD	63,730,921	2.204%
1ISP	IVV	*	SIN BURSATILIDAD	68,405,888	2.366%
1ISP	SPY	*	SIN BURSATILIDAD	134,063,150	4.637%
1ISP	USMV	*	SIN BURSATILIDAD	81,087,972	2.805%
1ISP	VARIOS	*	SIN BURSATILIDAD	142,634,138	4.833%
1ISP	VCO	*	SIN BURSATILIDAD	116,305,850	4.023%
1ISP	VWO	*	SIN BURSATILIDAD	74,257,867	2.568%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE				147,296,858	5.094%
52	STER-OP	ED	NA	147,296,858	5.094%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				3,982,932	0.138%
91	FUNO	15	AAA(mex)	3,982,932	0.138%
BONOS				641,654,457	22.193%
M	BONOS	381118	mxAAA	59,046,174	2.042%
M	VARIOS			582,608,284	20.150%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				598,826,740	20.711%
S	UDIBONO	220609	mxAAA	87,752,458	3.035%
S	UDIBONO	251204	mxAAA	99,505,841	3.442%
S	UDIBONO	281130	mxAAA	74,150,720	2.565%
S	UDIBONO	351122	mxAAA	61,504,749	2.127%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	109,948,353	3.803%
S	UDIBONO	461108	mxAAA	99,531,597	3.442%
S	VARIOS			66,433,023	2.298%
INVERSION EN DOLARES				1,440,524	0.050%
CHD	BSANT	2945049		1,440,524	0.050%
TOTAL CARTERA				2,891,292,979	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				2,872,539,193	
VAR ESTABLECIDO					2.000%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.703%

Cartera al 19/09/2019 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.

Categoría: Discrecional
Calificación:
Escala homogénea: NA

El Fondo de inversión NO se encuentra en una estrategia temporal de inversión