

**CARTERA MODELO FUSION  
XPERT-B  
NOVIEMBRE 2022**



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
<b>SERVICIOS FINANCIEROS</b>				<b>18,778,410</b>	<b>1.277%</b>
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	18,778,410	1.277%
<b>TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)</b>				<b>284,948,894</b>	<b>19.375%</b>
1ISP	EEM	*	ALTA	38,511,442	2.619%
1ISP	SLY	*	MEDIA	45,781,459	3.113%
1ISP	SPY	*	ALTA	57,540,857	3.913%
1ISP	VARIOS	*		52,678,710	3.582%
1ISP	VCO	*	ALTA	52,422,505	3.564%
1ISP	500U	N	BAJA	38,013,921	2.585%
<b>ACCIONES DE SI DEUDA</b>				<b>858,695,195</b>	<b>58.387%</b>
51	DEUDAOP	F	AAA/2	396,250,677	26.943%
51	FONSER1	F	AAA/2	270,441,903	18.389%
51	ST&ER-7	F	AAA/5	192,002,615	13.055%
<b>ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE</b>				<b>67,548,310</b>	<b>4.593%</b>
52	STER-OP	F	NA	67,548,310	4.593%
<b>SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)</b>				<b>145,543</b>	<b>0.010%</b>
56SP	SANHYDI	LX	NA	145,543	0.010%
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)</b>				<b>162,288,243</b>	<b>11.035%</b>
BI	CETES	230405	HR1	104,116,633	7.079%
BI	CETES	241003	HR1	58,171,610	3.955%
<b>BONOS</b>				<b>77,568,603</b>	<b>5.274%</b>
M	BONOS	240905	mAAA	77,568,603	5.274%
<b>INVERSION EN DOLARES</b>				<b>716,814</b>	<b>0.049%</b>
CHD	BSANT	2945000		716,814	0.049%
<b>APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS</b>				<b>-79</b>	<b>0.000%</b>
EAIM	BANSAN	0014619		-96	0.000%
EAIM	BANSAN	0019107		17	0.000%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>1,470,689,934</b>	<b>100.000%</b>
<b>VALOR DEL ACTIVO NETO</b>				<b>1,464,609,934</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO</b>					<b>2.100%</b>
<b>VAR OBSERVADO (Promedio)</b>					<b>0.401%</b>

Cartera al 30/11/2022 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**

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	7,559,170	1.908%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	58,211,762	14.691%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	9,280,222	2.342%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	10,328,446	2.607%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	6,803,964	1.717%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	7,720,223	1.948%
CEDES	25,407,948	6.412%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	10,632,177	2.683%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	276,920	0.070%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	21,630,041	5.459%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	5,588,566	1.410%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	69,497,769	17.539%
INVERSION EN DOLARES	4,329,891	1.093%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	2,343,818	0.591%
PRLV	3,292,539	0.831%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	775,919	0.198%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC	4,096,853	1.034%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	30,057,025	7.585%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	33,848,154	8.492%
	1,328,555	0.335%
	2,274,878	0.574%
	81,165,838	20.483%
<b>Total Tenencia Indirecta en DEUDAOP :</b>	<b>396,250,677</b>	<b>100.000%</b>

**Tenencia Indirecta en la cartera de FONSER1 :**  
**INSTRUMENTO**

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	1,096,302	0.405%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	73,716,787	27.258%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	58,619	0.022%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	6,189,390	2.289%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	6,787,172	2.510%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	3,255,674	1.204%
CEDES	22,686,799	8.389%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	4,956,827	1.833%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	196,430	0.073%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	4,396,615	1.626%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	3,095,672	1.145%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	19,264,470	7.123%
INVERSION EN DOLARES	241	0.000%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	134,286	0.050%
PRLV	16,188,015	5.986%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	536,046	0.198%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC	2,799,057	1.035%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	5,742,680	2.123%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	4,513,047	1.669%
	994,926	0.368%
	897,765	0.332%
	92,935,084	34.364%
<b>Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :</b>	<b>270,441,903</b>	<b>100.000%</b>

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

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	127,403,281	66.355%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	5,068,123	2.640%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	4,044,591	2.107%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	7,276,712	3.790%
INVERSION EN DOLARES	2,669,553	1.390%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	403,356	0.210%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	15,963,558	8.314%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	29,173,440	15.194%
<b>Total Tenencia Indirecta en ST&amp;ER-7 :</b>	<b>192,002,615</b>	<b>100.000%</b>