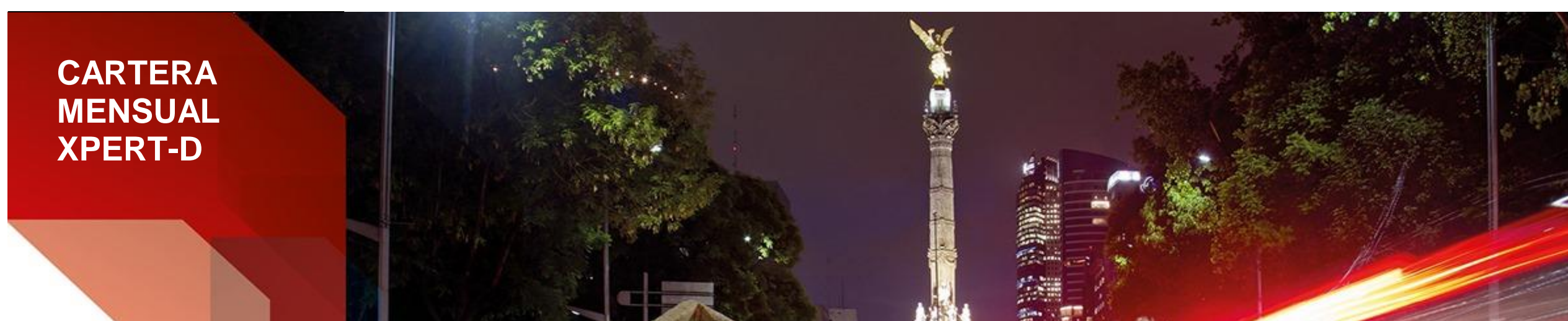


CARTERA MODELO FUSION
XPERT-D
NOVIEMBRE 2022



INSTRUMENTO			CALIFICACIÓN O BURSATILIDAD	VALOR MERCADO	%
SERVICIOS FINANCIEROS				8,782,200	1.424%
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	8,782,200	1.424%
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)				214,450,504	34.769%
1ISP	EEM	*	ALTA	26,653,550	4.321%
1ISP	GMF	*	BAJA	3,266,622	0.530%
1ISP	IVV	*	ALTA	35,840,973	5.811%
1ISP	SLY	*	MEDIA	21,095,713	3.420%
1ISP	SPY	*	ALTA	32,666,834	5.296%
1ISP	VGK	*	ALTA	25,691,159	4.165%
1ISP	VOO	*	ALTA	27,910,465	4.525%
1ISP	500U	N	BAJA	41,325,188	6.700%
ACCIONES DE SI DEUDA				244,988,556	39.721%
51	FONSER1	F	AAA/2	175,229,462	28.410%
51	ST&ER-7	F	AAA/5	69,759,094	11.310%
ACCIONES DE SI RENTA VARIABLE				50,294,022	8.154%
52	STER-OP	F	NA	50,294,022	8.154%
SOCIEDADES DE INVERSION EXTRANJERAS (SPOT)				145,543	0.024%
56SP	SANHYDI	LX	NA	145,543	0.024%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)				66,035,533	10.707%
BI	CETES	230405	HR1	41,935,866	6.799%
BI	CETES	241003	HR1	24,099,667	3.907%
BONOS				31,553,663	5.116%
M	BONOS	240905	mxAAA	31,553,663	5.116%
INVERSION EN DOLARES				527,230	0.085%
CHD	BSANT	2945000		527,230	0.085%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				465	0.000%
EAIM	BANSAN	0062427		-48	0.000%
EAIM	BANSAN	0003252		513	0.000%
TOTAL CARTERA				616,777,716	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				614,930,955	
VAR ESTABLECIDO					2.900%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.763%

Cartera al 30/11/2022 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	710,335	0.405%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D	47,763,874	27.258%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	37,982	0.022%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	2,109,474	1.204%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	4,397,664	2.510%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO	4,010,338	2.289%
CEDES	14,699,629	8.389%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	3,211,714	1.833%
CERTIFICADO BURSATIL DE CORTO PLAZO DENOMINADOS PAPEL COMERCIAL	127,275	0.073%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	2,848,732	1.626%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA	2,005,802	1.145%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION (CETES)	12,482,173	7.123%
INVERSION EN DOLARES	156	0.000%
OBLIGACIONES IND. COMER Y DE SERV.	0	0.000%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	87,009	0.050%
PRLV	10,488,823	5.986%
TITULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES	347,324	0.198%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC	1,813,614	1.035%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	3,720,898	2.123%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	2,924,172	1.669%
	581,695	0.332%
	644,650	0.368%
	60,216,130	34.364%
Total Tenencia Indirecta en FONSER1 :	175,229,462	100.000%

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

INSTRUMENTO	VALOR MERCADO	%
BONOS	46,288,627	66.355%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS	1,841,369	2.640%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO	1,469,496	2.107%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS	2,643,802	3.790%
INVERSION EN DOLARES	969,912	1.390%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS	146,549	0.210%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO	5,799,938	8.314%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.	10,599,401	15.194%
Total Tenencia Indirecta en ST&ER-7 :	69,759,094	100.000%