



INVESTMENT MANAGEMENT

SURABS1

AAA/2 MO

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M	BONOS	310529	mxAAA	44,874,713	10.22%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	18,993,661	4.33%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91	ENGECB	24	AAA.mx	13,013,897	2.96%
91				29,827,548	6.80%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	240725	HR1	74,391,292	16.95%
BI	CETES	241128	HR1	57,279,576	13.05%
BI	CETES	241003	HR1	21,747,802	4.95%
BI	CETES	260219	HR1	16,797,540	3.83%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC					
D8	CIT1125	FLOAT	A	10,102,015	2.30%
				287,028,043	65.39%
REPORTO					
LF	BONDEF	261231	mxAAA	68,026,207	15.50%
LF	BONDEF	270930	mxAAA	68,026,134	15.50%
				136,052,341	31.00%
OTROS VALORES					
				15,852,318	3.61%
				15,852,318	3.61%
	TOTAL CARTERA			438,932,703	100.00%
	ACTIVO NETO			398,566,940	
	VAR ESTABLECIDO \$			5,986,492	1.50%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			303,611	0.09%
	Cartera al:		27-Jun-24		

Para determinar el valor máximo de VaR de mercado, se considera la totalidad de la composición de la cartera y se estresa en los máximos permitidos, utilizando la metodología histórica donde se calcula el vigésimo quinto escenario con mayor exposición al riesgo tomando como base un periodo de muestra de 500 días anteriores (que representan el percentil 5 de la serie). El límite autorizado del VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 1.5% con una probabilidad del 95%