



INVESTMENT MANAGEMENT

SURREAL

AA/6 MO

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
LARGO PLAZO TASA REAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	69,643,178	3.16%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	311127	mxAAA	1,694,497,413	76.96%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				145,447,832	6.61%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE INDEMNIZACIÓN CARRETERA SEGREGABLES UDIZADOS					
2U				58,192,342	2.64%
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL					
95				70,653,478	3.21%
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS					
D2	CONM151	351215	BBB+	58,758,506	2.67%
NOTAS ESTRUCTURADAS DE MEDIANO PLAZO EMITIDAS EN EL EXTRANJERO					
D7	BAC871	251021	A	68,670,918	3.12%
				2,165,863,667	98.37%
OTROS VALORES					
				35,922,011	1.63%
				35,922,011	1.63%
	TOTAL CARTERA			2,201,785,678	100.00%
	ACTIVO NETO			2,203,670,042	
	VAR ESTABLECIDO \$			44,096,497	2.00%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			4,771,612	0.22%
	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 2.0% con una probabilidad del 95%.