



INVESTMENT MANAGEMENT

SURUDI

AAA/4 MO

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
MEDIANO PLAZO

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+	69,467,314	2.63%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	261203	mxAAA	886,773,754	33.52%
S	UDIBONO	281130	mxAAA	738,936,337	27.93%
S	UDIBONO	251204	mxAAA	708,733,480	26.79%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				67,734,419	2.56%
				2,471,645,305	93.44%
REPORTO					
LF	BONDEF	261231	mxAAA	58,363,382	2.21%
				58,363,382	2.21%
OTROS VALORES					
				115,210,901	4.36%
				115,210,901	4.36%
	TOTAL CARTERA			2,645,219,587	100.00%
	ACTIVO NETO			2,615,493,835	
	VAR ESTABLECIDO \$			11,774,659	0.45%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			2,164,501	0.08%
	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 0.45% con una probabilidad del 95%.