



INVESTMENT MANAGEMENT

SURUSD

NA

FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE
ESPECIALIZADAS EN DEUDA

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DEL GOBIERNO FEDERAL COLOCADOS EN EL EXTERIOR UMS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
D1SP	MEXG29	260121	BBB-	71,684,576	19.48%
D1SP	MEXC46	270328	BBB-	57,709,607	15.68%
D1SP	MEXE02	280111	BBB-	35,538,229	9.66%
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES					
CHD	BACMEXT	5193582		18,172,252	4.94%
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ISP	VCSH	*	ALTA	42,727,005	11.61%
1ISP	VGIT	*	ALTA	42,336,421	11.50%
1ISP	VGSH	*	ALTA	35,881,911	9.75%
1ISP	IEI	*	ALTA	28,928,549	7.86%
1ISP	SHY	*	ALTA	24,645,966	6.70%
				357,624,516	97.17%
OTROS VALORES				10,398,514	2.83%
				10,398,514	2.83%
TOTAL CARTERA				368,023,030	100.00%
ACTIVO NETO				367,958,043	
VAR ESTABLECIDO \$				7,840,750	2.13%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				1,325,005	0.36%
Cartera al:			27-Jun-24		
<p>Para calcular el límite máximo de VaR, se considera la totalidad de la composición de la cartera. El límite superior o Valor en Riesgo máximo que se presenta en el régimen de inversión se obtiene calculando el quinto peor escenario con base en la metodología histórica, y asumiendo una composición de cartera en los máximos permitidos.</p>					

Direcciones electrónicas para consultar la Tenencia de Activos Objeto de Inversión:

IEI *

<http://www.bloomberg.com/quote/SHY:US>

VGSH *

<http://www.bloomberg.com/quote/VGSH:US>