



INVESTMENT MANAGEMENT

SURB05

AAA/5 MO

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M	BONOS	310529	mxAAA	1,651,437,534	39.84%
M	BONOS	290531	mxAAA	893,828,624	21.57%
M	BONOS	270603	mxAAA	284,297,128	6.86%
M	BONOS	330526	mxAAA	265,121,667	6.40%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	124,379,718	3.00%
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS					
94				110,060,748	2.66%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				509,292,681	12.29%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC					
D8				121,053,827	2.92%
				3,959,471,926	95.53%
OTROS VALORES					
				185,319,253	4.47%
				185,319,253	4.47%
	TOTAL CARTERA			4,144,791,179	100.00%
	ACTIVO NETO			4,141,567,598	
	VAR ESTABLECIDO \$			41,437,494	1.00%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			20,000,519	.48%
	Cartera al:		30-Apr-24		

Para calcular el límite máximo de VaR, se considera la totalidad de la composición de la cartera. El límite autorizado de VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 1.20% con una probabilidad del 95%.