



INVESTMENT MANAGEMENT

SURB05

AAA/5 MO

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA</b>					
M	BONOS	310529	mxAAA	1,647,492,235	39.81%
M	BONOS	290531	mxAAA	893,415,280	21.59%
M	BONOS	270603	mxAAA	360,593,222	8.71%
M	BONOS	330526	mxAAA	264,852,639	6.40%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL</b>					
MP	BONOS	270304	HR AA+	124,231,841	3.00%
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS</b>					
94				109,941,428	2.66%
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>					
91				510,588,090	12.34%
<b>TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>					
D8				120,902,897	2.92%
				<b>4,032,017,632</b>	<b>97.43%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				106,232,909	2.57%
				<b>106,232,909</b>	<b>2.57%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>4,138,250,541</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>4,136,519,913</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>41,382,890</b>	<b>1.00%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>9,764,862</b>	<b>0.24%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>25-Apr-24</b>		

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%.