



INVESTMENT MANAGEMENT

SURCETE

AAA/1 MO

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F					
LF	BONDES F	241107	mxAAA	299,949,069	2.41%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	240627	HR1	1,962,566,800	15.76%
BI	CETES	240725	HR1	1,430,030,700	11.48%
BI	CETES	240822	HR1	1,398,631,720	11.23%
BI	CETES	240808	HR1	1,288,351,848	10.35%
BI	CETES	241128	HR1	1,058,280,369	8.50%
BI	CETES	240711	HR1	1,055,140,884	8.47%
BI	CETES	240502	HR1	948,263,115	7.62%
BI	CETES	250206	HR1	591,737,384	4.75%
BI	CETES	241003	HR1	511,406,902	4.11%
				10,544,358,791	84.68%
REPORTO					
LF	BONDES F	321021	mxAAA	908,382,337	7.30%
IQ	BPAG91	290111	mxAAA	677,765,105	5.44%
				1,586,147,442	12.74%
OTROS VALORES					
				321,292,915	2.58%
				321,292,915	2.58%
TOTAL CARTERA				12,451,799,148	100.00%
ACTIVO NETO				12,444,454,006	
VAR ESTABLECIDO \$				8,716,259	0.07%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				880,261	0.01%
Cartera al:			25-Apr-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. El VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 0.02% con una probabilidad del 95%