



INVESTMENT MANAGEMENT

SURGOB

AAA/2 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 CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M	BONOS	241205	mxAAA	747,939,058	27.26%
M	BONOS	250306	mxAAA	191,777,326	6.99%
M	BONOS	240905	mxAAA	159,896,819	5.83%
M				110,920,947	4.04%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	62,115,913	2.26%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	241128	HR1	468,265,650	17.06%
BI	CETES	250206	HR1	458,711,150	16.72%
BI	CETES	250320	HR1	454,209,150	16.55%
BI	CETES	241003	HR1	76,187,248	2.78%
				2,730,023,261	99.48%
OTROS VALORES				14,171,882	0.52%
				14,171,882	0.52%
	TOTAL CARTERA			2,744,195,143	100.00%
	ACTIVO NETO			2,741,996,497	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,744,195	0.10%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			678,530	0.02%
	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 (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 0.10% con una probabilidad del 95%.