

SURBONO

AAAf/S6

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			1,780,670	77.635%
M	BONOS	220609	NO APLICA	522,940	22.800%
M	BONOS	241205	NO APLICA	367,657	16.029%
M	BONOS	231207	NO APLICA	280,422	12.226%
M	BONOS	270603	NO APLICA	253,917	11.071%
M	BONOS	260305	NO APLICA	201,364	8.779%
M	BONOS	211209	NO APLICA	134,152	5.849%
M	BONOS	471107	NO APLICA	20,218	0.881%
	Cert. Bursatiles Bancarios			18,813	0.820%
94	BINBUR	14-7	mxAAA	18,813	0.820%
	Certificado Bursatil			256,786	11.196%
91	ENCAPCB	18-2	mxAAA	39,803	1.735%
91	DAIMLER	18-4	mxAAA	30,243	1.319%
91	BIMBO	17	mxAA+	29,313	1.278%
91	LALA	18	AA(mex)	26,205	1.143%
91	KOF	13	A2	20,603	0.898%
91	FERROMX	11	mxAAA	15,878	0.692%
91	OMA	14	mxAAA	14,642	0.638%
91	TOYOTA	17-2	mxAAA	11,434	0.499%
91	DAIMLER	18-2	AAA	10,295	0.449%
91	TLEVISA	10	Baa1	10,097	0.440%
91	UNFINCB	17-3	mxAAA	10,042	0.438%
91	UNFINCB	16-2	mxAAA	9,783	0.427%
91	UNFINCB	17-4	mxAAA	9,718	0.424%
91	PAQPCB	16	AAA(mex)	8,195	0.357%
91	FUNO	15	AAA(mex)	7,047	0.307%
91	ALSEA	15-2	AA-(mex)	3,488	0.152%
	Eurobonos a Mediano Plazo MXP			40,331	1.758%
D8	JPM	1-07	A-	20,396	0.889%
D8	GECC	1-07	A	16,996	0.741%
D8	BAC	3-10	A	2,939	0.128%
	Notas Estruc. Int. a descuento			37,481	1.634%
D2	REDC933	280610	BBB+	37,481	1.634%
	Udibonos UDIS			86,538	3.773%
S	UDIBONO	220609	NO APLICA	86,538	3.773%
	Valores paraestatales Rendim.			11,386	0.496%
95	PEMEX	13-2	A-	11,386	0.496%
	Reportos			61,625	2.687%
IS	BPA182	240307	NO APLICA	61,625	2.687%
	TOTAL CARTERA			2,293,630	100.000%
	ACTIVO NETO			2,230,338	
	VAR ESTABLECIDO \$			26,764	1.200%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,384	0.377%
	Cartera al:			28-sep-18	

Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.