

SURBONO

AAA/5 MO

FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	241205	NO APLICA	1,059,135	23.758%
M	BONOS	270603	NO APLICA	866,578	19.438%
M	BONOS	290531	NO APLICA	807,556	18.114%
M	BONOS	260305	NO APLICA	756,722	16.974%
M	BONOS	240905	NO APLICA	575,563	12.911%
				4,065,554	91.195%
CERTIFICADOS BURSATILES					
91	GPH	20	AAA (mex)	41,018	0.920%
91	BIMBO	17	mxAA+	31,439	0.705%
91	LALA	18	AA (mex)	18,933	0.425%
91	AGUA	17-2X	AA	15,832	0.355%
91	LALA	19	AA (mex)	14,097	0.316%
91	TOYOTA	17-2	mxAAA	12,865	0.289%
91	DAIMLER	18-2	AAA	10,893	0.244%
91	KOF	13	A2	10,366	0.233%
91	ALSEA	15-2	A- (mex)	9,333	0.209%
91	FUNO	15	AAA (mex)	8,251	0.185%
91	FUNO	17	AAA (mex)	5,765	0.129%
91	LALA	20	AA (mex)	3,166	0.071%
D8	JPM	1-07	A-	23,621	0.530%
D8	GECC	1-07	BBB+	18,579	0.417%
D2	REDC933	280610	BBB	38,398	0.861%
95	FEFA	20-2	mxAAA	20,502	0.460%
				283,058	6.349%
VALORES EN REPORTEO					
LD	BONDESD	220113	NO APLICA	109,483	2.456%
				109,483	2.456%
TOTAL CARTERA				4,458,095	100.000%
ACTIVO NETO				4,341,568	
VAR ESTABLECIDO \$				52,099	1.200%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				11,968	0.300%
Cartera al:			29-ene.-21		

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