



INVESTMENT MANAGEMENT

**SURCETE**

AAA/1 MO

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

| T.VALOR   | EMISORA | SERIE  | CALIF / BURS     | VALOR TOTAL           | %              |
|---|---------|--------|------------------|-----------------------|----------------|
| <b>DIRECTO</b>  |         |        |                  |                       |                |
| <b>CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b> |         |        |                  |                       |                |
| BI  | CETES   | 250821 | HR1              | 1,138,328,257         | 10.50%         |
| BI  | CETES   | 250430 | HR1              | 1,137,767,602         | 10.49%         |
| BI  | CETES   | 250918 | HR1              | 1,052,618,532         | 9.71%          |
| BI  | CETES   | 250904 | HR1              | 1,044,359,254         | 9.63%          |
| BI  | CETES   | 261001 | HR1              | 874,470,551           | 8.06%          |
| BI  | CETES   | 250220 | HR1              | 826,724,878           | 7.62%          |
| BI  | CETES   | 260219 | HR1              | 820,867,564           | 7.57%          |
| BI  | CETES   | 250206 | HR1              | 809,150,082           | 7.46%          |
| BI  | CETES   | 250724 | HR1              | 651,275,317           | 6.00%          |
| BI  | CETES   | 250320 | HR1              | 420,946,909           | 3.88%          |
| BI  | CETES   | 261126 | HR1              | 298,714,806           | 2.75%          |
| BI  | CETES   | 250403 | HR1              | 292,625,280           | 2.70%          |
| BI  | CETES   | 260611 | HR1              | 261,087,150           | 2.41%          |
| BI  |         |        |                  | 664,197,141           | 6.12%          |
|   |         |        |                  | <b>10,293,133,322</b> | <b>94.90%</b>  |
| <b>REPORTO</b>  |         |        |                  |                       |                |
| LF  | BONDESF | 261001 | mxAAA            | 366,393,049           | 3.38%          |
|   |         |        |                  | <b>366,393,049</b>    | <b>3.38%</b>   |
| <b>OTROS VALORES</b>  |         |        |                  |                       |                |
|   |         |        |                  | 186,409,197           | 1.72%          |
|   |         |        |                  | <b>186,409,197</b>    | <b>1.72%</b>   |
| <b>TOTAL CARTERA</b>  |         |        |                  | <b>10,845,935,567</b> | <b>100.00%</b> |
| <b>ACTIVO NETO</b>  |         |        |                  | <b>10,836,374,108</b> |                |
| <b>VAR ESTABLECIDO \$</b>   |         |        |                  | <b>7,592,155</b>      | <b>.07%</b>    |
| <b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>                                  |         |        |                  | <b>4,177,229</b>      | <b>.04%</b>    |
| <b>Cartera al:</b>  |         |        | <b>31-Dec-24</b> |                       |                |

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 0.07% con una probabilidad del 95%