

SURBONO

AAAf/S6

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			1.905.755.607	84,229%
M	BONOS	210610	NO APLICA	594.413.838	26,271%
M	BONOS	241205	NO APLICA	406.097.237	17,948%
M	BONOS	220609	NO APLICA	300.827.836	13,296%
M	BONOS	260305	NO APLICA	283.206.192	12,517%
M	BONOS	270603	NO APLICA	190.836.918	8,434%
M	BONOS	231207	NO APLICA	130.373.585	5,762%
	Cert. Bursatiles Bancarios			19.592.369	0,866%
94	BINBUR	14-7	HR AAA	19.592.369	0,866%
	Certificado Bursatil			66.500.019	2,939%
90	GDFCB	10-2	NO APLICA	66.500.019	2,939%
	Certificado Bursatil			86.524.273	3,824%
91	TELFIM	10	Aa3.mx	33.448.457	1,478%
91	TOYOTA	17-2	AAA(mex)	12.316.133	0,544%
91	TLEVISA	10	Aa1.mx	10.178.576	0,450%
91	UNFINCB	16-2	HR AAA	10.089.301	0,446%
91	PAQPCB	16	AAA(mex)	9.597.006	0,424%
91	FUNO	15	AAA(mex)	7.237.400	0,320%
91	ALSEA	15-2	A+(mex)	3.657.401	0,162%
	Eurobonos a Mediano Plazo MXP			119.657.648	5,289%
D8	KEXIM	1-07	AA	48.460.949	2,142%
D8	GECC	1-08	A1	28.525.597	1,261%
D8	JPM	1-07	A+	21.449.047	0,948%
D8	GECC	1-07	A1	18.306.284	0,809%
D8	BAC	3-10	A	2.915.770	0,129%
	Notas Estruc. Int. a descuento			37.944.702	1,677%
D2	REDC933	280610	BBB	37.944.702	1,677%
	Valores paraestatales Rendim.			21.989.805	0,972%
95	PEMEX	13-2	Aa3.mx	12.128.632	0,536%
95	PEMEX	11-3	A	9.861.173	0,436%
	Reportos			4.627.158	0,205%
LD	BONDESD	210121	NO APLICA	4.627.158	0,205%
	TOTAL CARTERA			2.262.591.580	100,000%
	ACTIVO NETO			2.226.795.233	
	VAR ESTABLECIDO \$			26.721.543	1,200%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8.053.904	0,360%
	Cartera al:			17-ago-17	

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