

## DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN

**SURA 2, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda administrado por SURA Investment Management México, S.A de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión.**

Tipo	Instrumentos de Deuda	Clase y Serie Accionaria	Posibles Adquirentes	Montos Mínimos de Inversión (\$)
Clasificación	IDCPGUB / Corto Plazo Gubernamental	BDF	Personas Físicas	Serie sin monto mínimo de inversión.
Clave de Pizarra	SURCETE			
Calificación	AAA/1			
Fecha de Autorización	04/03/2016			

**Importante:** El valor de una sociedad de inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de inversión:** El Fondo buscará obtener ingresos atractivos, tratando de preservar el capital o, incluso obtener ingresos adicionales derivados de movimientos en los mercados.

El Fondo invertirá exclusivamente en valores gubernamentales de manera directa y si el gestor lo considera adecuado, a través de mecanismos de inversión colectiva (acciones de sociedades de inversión y ETFs que a su vez inviertan exclusivamente en valores gubernamentales). La participación en Certificados de la Tesorería (CETES) deberá ser como mínimo del 51%, para cumplir con esta participación mínima, se contabilizará la posición en directo en CETES del Fondo, así como las posiciones en CETES que se tengan a través de sociedades de inversión y ETFs. Toda vez que los ETF's utilizados, revelan su cartera en la página de internet del proveedor de forma diaria, se utilizará esta fuente para asegurar el cumplimiento con el requerimiento mínimo de CETES. El Fondo podrá invertir en reporto, en calidad de reportadora y con subyacente gubernamental, hasta por un 49%. Se podrá invertir hasta en un 40% del Fondo, en mecanismos de inversión colectiva (acciones de sociedades de inversión y ETFs) que inviertan en valores de gubernamentales. No existe plazo mínimo de permanencia, sin embargo, el inversionista deberá considerar lo establecido en el horizonte fijado, por lo que se recomienda que, para lograr el objetivo de inversión, permanezca en el Fondo por lo menos seis meses.

**Régimen y política de inversión:**

a) Estrategia de administración: Activa

b) Parámetros:

1.-Valores de fácil realización y/o valores con vencimiento menor a 3 meses 80% 100%

2.-Valores Gubernamentales 100%

3.-Certificados de la Tesorería 51% 100%

4.-Reporto 0% 49%

5.-Valores denominados en pesos o UDIS 100%

6.-Acciones de Sociedades de Inversión y ETFs 0% 40%

c) Política de inversión: El Fondo buscará aprovechar oportunidades de mercado para generar un rendimiento superior al del índice de referencia, lo que implica que no replicará el mismo y esto puede generar un riesgo adicional. El objetivo del Fondo es seleccionar exclusivamente valores gubernamentales en tasa de descuento, tasa nominal y /o real, con cupón fijo y/o revisable en directo así como a través de sociedades de inversión y /o ETF's que le permitan al Fondo tener un rendimiento atractivo en el corto plazo y a su vez le permitan tener un desempeño estable en su horizonte de inversión durante etapas de movimientos de mercado. Para la inversión en ETF's gubernamentales, no estarán apalancados ni podrán realizar réplicas sintéticas, los ETF's deberán tener 100% de exposición a instrumentos de deuda mexicana gubernamental y deberán operar en la BMV y /o estar listados en el SIC o estar registrados en el RNV. Para las sociedades de inversión, estas deberán de estar invertidas exclusivamente en instrumentos gubernamentales y deberán tener la máxima calificación crediticia (AAA) y deberán de tener liquidez no mayor a 24 horas. d) Índice o base de referencia : PIPCetes-28d e) El Fondo no invertirá en activos emitidos por sociedades del mismo consorcio empresarial al que está pertenece. f) El Fondo no invertirá en instrumentos financieros derivados, ni en valores estructurados, ni en títulos fiduciarios de capital (CKD's), ni en valores respaldados por activos (ABS). g) El fondo podrá realizar operaciones de préstamo de valores

**Información Relevante:** No existe información relevante que revelar.

Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos: 0.06% con una probabilidad del 95%.

Bajo condiciones normales de mercado, la pérdida que en un escenario pesimista (5 en 100 veces) puede enfrentar la sociedad de inversión en un lapso de un día, es de \$0.60 pesos por cada \$1000.00 invertidos. (Este dato es sólo una estimación y aplica solo en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

**Desempeño histórico**

Índice de referencia: PIPCetes-28d

**Tabla de Rendimientos anualizados**

	Ultimo Mes	Ultimos 3 Meses	Ultimos 6 Meses	Año 2017	Año 2018	Año 2019
Rendimiento Bruto	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0
Rendimiento Neto	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Tasa libre de riesgo (Cetes 28 días)*	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Índice de Referencia	7.525614	7.603560	8.160574	8.234039	8.102312	8.102312

El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.

\*La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones, impuestos o cualquier otro gasto.

El desempeño de la sociedad en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá en el futuro.

**Composición de la cartera de inversión**

**Principales inversiones al mes de Enero de 2020**

Activo objeto de inversión subyacente			Monto (Miles \$)		%
Emisora	Nombre	Tipo			
BONDESD	240822	LD	\$ 1.351.463.729		20.53
CETES	200507	BI	\$ 1.080.393.160		16.41
CETES	200402	BI	\$ 791.015.360		12.02
CETES	200618	BI	\$ 682.098.550		10.36
CETES	200423	BI	\$ 590.852.520		8.98
CETES	200227	BI	\$ 589.308.531		8.95
UDIBONO	201210	S	\$ 400.935.551		6.09
CETES	200213	BI	\$ 349.267.311		5.31
CETES	200319	BI	\$ 317.060.241		4.82
BONDESD	200730	LD	\$ 301.105.176		4.58
Totales			\$6,453,500,129.00		98.05

**Sector de Actividad Económica**

