



INVESTMENT MANAGEMENT

SURREAL

AAf.mx  
MRA6.mxFONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
LARGO PLAZO TASA REAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA</b>					
M	BONOS	471107	mxAAA	93,875,133	2.62%
M				102,723,455	2.86%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL</b>					
MP	BONOS	270304	HR AA+	84,581,005	2.36%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES</b>					
S	UDIBONO	311127	mxAAA	1,190,144,751	33.16%
S	UDIBONO	351122	mxAAA	789,401,195	21.99%
S	UDIBONO	340824	mxAAA	741,202,942	20.65%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	87,427,124	2.44%
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>					
91				118,013,764	3.29%
				3,207,369,371	89.36%
<b>REPORTO</b>					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	97,006,676	2.70%
				97,006,676	2.70%
<b>OTROS VALORES</b>					
				284,810,298	7.94%
				284,810,298	7.94%
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>3,589,186,344</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>3,584,038,280</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>71,712,051</b>	<b>2.00%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>18,288,431</b>	<b>.53%</b>
Cartera al:				30-Jan-26	

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 (que representan el percentil 5 de la serie). El límite autorizado del VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 2.0% con una probabilidad del 95%.