



INVESTMENT MANAGEMENT

SURABS1

AAAf.mx  
MRA2.mxFONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL</b>					
MP	BONOS	270304	HR AA+	23,067,628	4.15%
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>					
91	ENGENCB	24	AAA.mx	13,041,994	2.35%
91				35,062,979	6.31%
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>					
BI	CETES	270121	HR1	204,412,365	36.78%
BI	CETES	270708	HR1	108,186,084	19.47%
BI	CETES	270318	HR1	92,257,450	16.60%
				476,028,500	85.66%
<b>REPORTO</b>					
LF	BONDESF	261001	mxAAA	33,173,174	5.97%
IS	BPA182	280412	mxAAA	32,307,809	5.81%
				65,480,983	11.78%
<b>OTROS VALORES</b>					
				14,238,384	2.56%
				14,238,384	2.56%
<b>TOTAL CARTERA</b>					
				555,747,867	100.00%
<b>ACTIVO NETO</b>					
				554,594,914	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>					
				8,336,197	1.50%
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>					
				325,213	.06%
Cartera al:					
				30-Jan-26	
<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 (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 1.5% con una probabilidad del 95%</b>					