



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	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M	BONOS	471107	mxAAA	95,677,013	2.56%
M				104,545,806	2.79%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	85,256,472	2.28%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	311127	mxAAA	1,216,182,091	32.48%
S	UDIBONO	351122	mxAAA	805,457,454	21.51%
S	UDIBONO	340824	mxAAA	756,382,227	20.20%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	89,325,947	2.39%
S				101,503,378	2.71%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				119,337,758	3.19%
				3,373,668,147	90.10%
REPORTO					
M	BONOS	320415	mxAAA	133,083,902	3.55%
				133,083,902	3.55%
OTROS VALORES					
				237,631,064	6.35%
				237,631,064	6.35%
TOTAL CARTERA				3,744,383,112	100.00%
ACTIVO NETO				3,694,235,866	
VAR ESTABLECIDO \$				73,914,008	2.00%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				18,330,705	.50%
Cartera al:			27-Feb-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%.