



INVESTMENT MANAGEMENT

SURUDI

AAAf.mx  
MRA4.mxFONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
MEDIANO PLAZO

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+	87,024,011	2.65%
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES</b>					
S	UDIBONO	281130	mxAAA	1,890,521,379	57.50%
S	UDIBONO	311127	mxAAA	714,599,777	21.73%
S	UDIBONO	290830	mxAAA	355,355,266	10.81%
				<b>3,047,500,433</b>	<b>92.69%</b>
<b>REPORTO</b>					
IS	BPA182	310327	mxAAA	74,199,844	2.26%
				<b>74,199,844</b>	<b>2.26%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				<b>166,214,778</b>	<b>5.06%</b>
				<b>166,214,778</b>	<b>5.06%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>3,287,915,056</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>3,286,153,294</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>14,793,192</b>	<b>0.45%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>6,300,621</b>	<b>0.19%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>25-Jun-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 0.45% con una probabilidad del 95%.