INVESTMENT MANAGEMENT

SURREAL

AAf.mx
MRA6.mx

FONDO 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				229,933,267	5.02%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	351122	mxAAA	1,890,298,134	41.28%
S	UDIBONO	340824	mxAAA	1,512,633,193	33.03%
S	UDIBONO	311127	mxAAA	218,304,202	4.77%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	121,241,577	2.65%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				106,716,252	2.33%
				4,079,126,624	89.07%
REPORTO					
LF	BONDESF	300725	mxAAA	133,355,744	2.91%
				133,355,744	2.91%
OTROS VALORES				366,961,173	8.01%
				366,961,173	8.01%

TOTAL CARTERA	**4,579,443,542**	**100.00%**
ACTIVO NETO	**4,695,904,305**	
VAR ESTABLECIDO $	**93,949,295**	**2.00%**
VAR OBSERVADO PROMEDIO $	**25,007,728**	**.56%**
Cartera al:	**29-May-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%.