



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 EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	351122	mxAAA	2,267,348,217	45.80%
S	UDIBONO	340824	mxAAA	1,695,294,743	34.25%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	114,576,677	2.31%
S	UDIBONO	461108	mxAAA	106,516,479	2.15%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				107,985,574	2.18%
				4,291,721,689	86.70%
REPORTO					
LF	BONDESF	310320	mxAAA	342,527,386	6.92%
				342,527,386	6.92%
OTROS VALORES					
				316,050,928	6.38%
				316,050,928	6.38%
	TOTAL CARTERA			4,950,300,003	100.00%
	ACTIVO NETO			4,944,332,123	
	VAR ESTABLECIDO \$			98,913,021	2.00%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			26,473,650	0.54%
	Cartera al:		25-Jun-26		
<p>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%.</p>					