



INVESTMENTS

SURUDI

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

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M	BONOS	320415	mxAAA	80,741,678	2.00%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	87,827,123	2.18%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	281130	mxAAA	2,332,524,422	57.82%
S	UDIBONO	311127	mxAAA	818,729,523	20.29%
S	UDIBONO	290830	mxAAA	527,750,701	13.08%
				3,847,573,447	95.37%
OTROS VALORES				186,876,155	4.63%
				186,876,155	4.63%
TOTAL CARTERA				4,034,449,602	100.00%
ACTIVO NETO				4,032,875,234	
VAR ESTABLECIDO \$				18,158,233	0.45%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				7,269,283	0.18%
Cartera al:			13-Aug-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 0.45% con una probabilidad del 95%.