



INVESTMENTS

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	2,275,545,915	45.95%
S	UDIBONO	340824	mxAAA	1,785,496,487	36.05%
S	UDIBONO	461108	mxAAA	107,097,906	2.16%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				103,856,823	2.10%
				4,271,997,130	86.26%
REPORTO					
M	BONOS	290301	mxAAA	333,522,565	6.73%
				333,522,565	6.73%
OTROS VALORES					
				346,976,013	7.01%
				346,976,013	7.01%
TOTAL CARTERA				4,952,495,709	100.00%
ACTIVO NETO				4,949,229,381	
VAR ESTABLECIDO \$				99,031,087	2.00%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				25,256,690	0.51%
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 2.0% con una probabilidad del 95%.