

PROD100

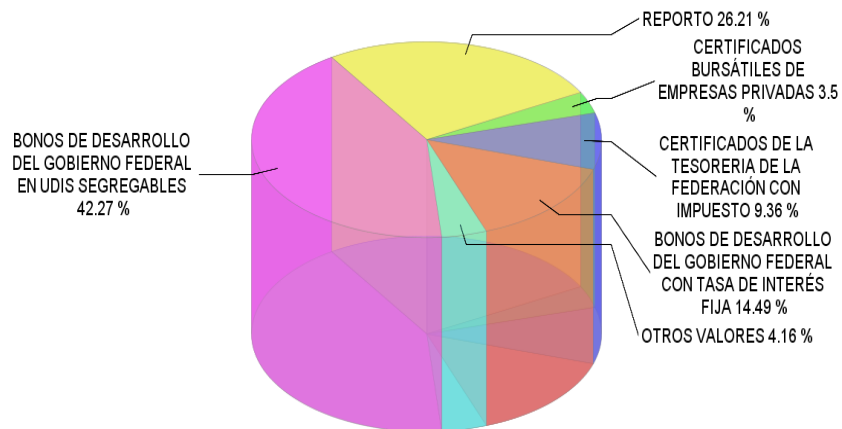
AAf.mx
MRA4.mx

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
ACCIONES DE FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	SURREAL	BFF	AA/6	192,744,294	25.85%
51	FONDEO	BFF	AAA/1	163,159,649	21.88%
51	SURUDI	BFF	AAA/4	138,605,696	18.59%
51	SURB10	BFF	AAA/4	77,120,926	10.34%
51	SURB05	BFF	AAA/5	48,155,000	6.46%
51	SURABS1	BFF	AAA/2	34,048,840	4.57%
51	SURCETE	BFF	AAA/1	31,636,567	4.24%
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ISP	VGSH	*	ALTA	43,605,913	5.85%
1ISP	IEI	*	ALTA	16,504,088	2.21%
				745,580,973	100.00%
TOTAL CARTERA				745,580,973	100.00%
ACTIVO NETO				743,692,503	
VAR ESTABLECIDO \$				4,474,860	0.60%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				1,538,979	0.21%
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 0.60% con una probabilidad del 95%.

Composición de las Carteras de los Fondos Origen



Direcciones electrónicas para consultar la Tenencia de Activos Objeto de Inversión:

SUR1E BOE1	https://www.suraim.com.mx/#
SURGOB BOE1	https://www.suraim.com.mx/#
SURCORP BOE1	https://www.suraim.com.mx/#