



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 SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	88,554,558	2.19%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	281130	mxAAA	1,298,866,104	32.09%
S	UDIBONO	290830	mxAAA	1,233,718,783	30.48%
S	UDIBONO	311127	mxAAA	1,113,526,302	27.51%
				3,734,665,748	92.26%
REPORTO					
LF	BONDESF	300124	mxAAA	149,466,643	3.69%
				149,466,643	3.69%
OTROS VALORES				163,727,236	4.04%
				163,727,236	4.04%
TOTAL CARTERA				4,047,859,626	100.00%
ACTIVO NETO				4,058,949,443	
VAR ESTABLECIDO \$				18,274,370	.45%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				7,491,295	.19%
Cartera al:			30-Sep-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%.					