



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 CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M	BONOS	471107	mxAAA	123,240,952	2.44%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	351122	mxAAA	2,276,305,769	45.10%
S	UDIBONO	340824	mxAAA	1,917,674,708	38.00%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	280803	mxA-1+	173,661,360	3.44%
				4,490,882,789	88.98%
REPORTO					
LF	BONDESF	300124	mxAAA	102,248,804	2.03%
				102,248,804	2.03%
OTROS VALORES				453,668,514	8.99%
				453,668,514	8.99%
TOTAL CARTERA				5,046,800,107	100.00%
ACTIVO NETO				5,041,993,181	
VAR ESTABLECIDO \$				100,873,200	2.00%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				23,974,189	.48%
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 2.0% con una probabilidad del 95%.