



INVESTMENTS

SURABS1

AAAf.mx
MRA2.mxFONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
DISCRECIONAL

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+	24,212,470	3.65%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				34,401,780	5.19%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	270708	mxA-1+	293,668,766	44.27%
BI	CETES	270318	mxA-1+	96,869,500	14.60%
BI	CETES	270121	mxA-1+	95,052,656	14.33%
BI	CETES	270915	mxA-1+	46,646,825	7.03%
				590,851,997	89.08%
REPORTO					
LF	BONDESF	300124	mxAAA	30,076,400	4.53%
IM	BPAG28	290503	mxAAA	30,076,392	4.53%
				60,152,792	9.07%
OTROS VALORES				12,301,995	1.85%
				12,301,995	1.85%
TOTAL CARTERA				663,306,785	100.00%
ACTIVO NETO				615,757,059	
VAR ESTABLECIDO \$				9,250,035	1.50%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				164,962	.03%
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 1.5%con una probabilidad del 95%					