SURREAL

AAf.mx
MRA6.mx

FONDO 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	2,329,477,266	45.83%
S	UDIBONO	340824	mxAAA	1,960,733,963	38.57%
				4,290,211,229	84.40%
REPORTO					
LF	BONDESF	300725	mxAAA	291,660,934	5.74%
				291,660,934	5.74%
OTROS VALORES				501,052,359	9.86%
				501,052,359	9.86%

TOTAL CARTERA		**5,082,924,522**	**100.00%**
ACTIVO NETO		**5,081,151,722**	
VAR ESTABLECIDO $		**101,660,932**	**2.00%**
VAR OBSERVADO PROMEDIO $		**24,558,478**	**.48%**
Cartera al:	**30-Oct-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%.