sura INVESTMENTS

SURABS1

AAAf.mx
MRA2.mx

FONDO 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+	24,373,540	3.94%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				29,737,117	4.80%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	270708	mxA-1+	296,181,502	47.84%
BI	CETES	270318	mxA-1+	97,559,790	15.76%
BI	CETES	270121	mxA-1+	56,223,002	9.08%
BI	CETES	270915	mxA-1+	47,121,210	7.61%
				551,196,161	89.03%
REPORTO					
IQ	BPAG91	300110	mxAAA	25,469,402	4.11%
LF	BONDESF	310320	mxAAA	25,469,216	4.11%
				50,938,618	8.23%
OTROS VALORES				16,961,092	2.74%
				16,961,092	2.74%

TOTAL CARTERA		**619,095,871**	**100.00%**
ACTIVO NETO		**618,104,464**	
VAR ESTABLECIDO $		**9,286,410**	**1.50%**
VAR OBSERVADO PROMEDIO $		**204,046**	**.03%**
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 1.5%con una probabilidad del 95%