PROD100

AAf.mx
MRA4.mx

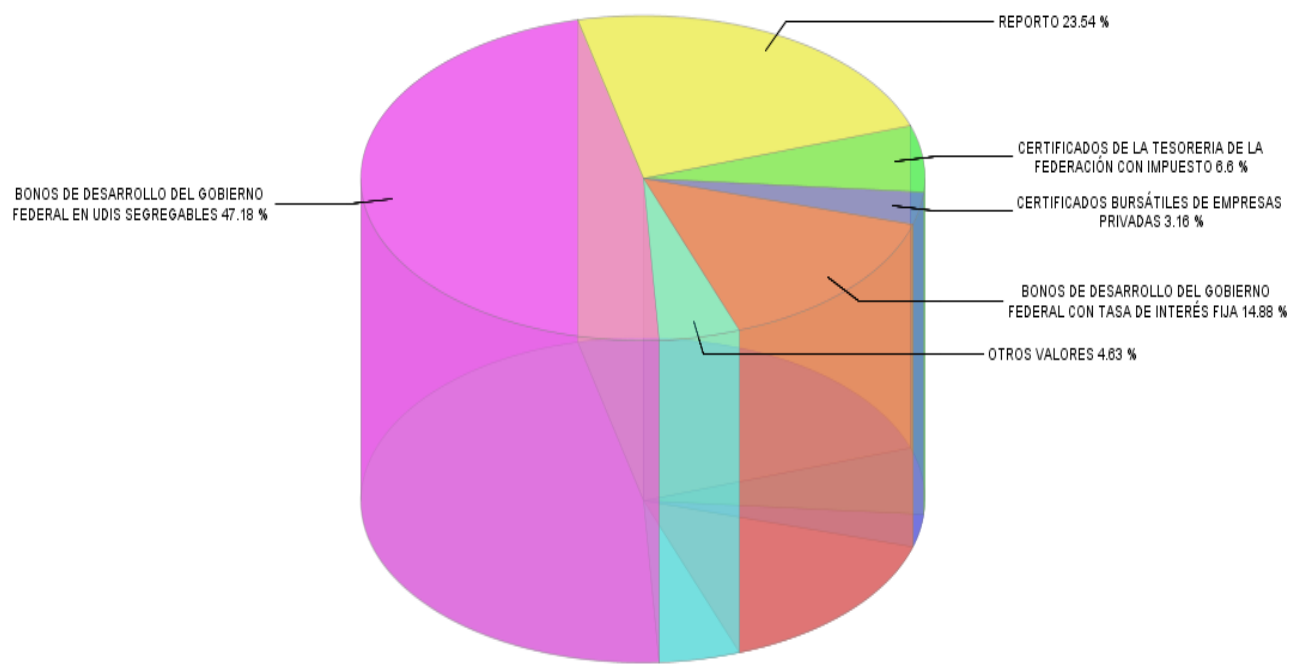
FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
ACCIONES DE FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	SURREAL	BFF	AA/6	192,873,263	27.57%
51	SURUDI	BFF	AAA/4	141,654,016	20.25%
51	FONDEO	BFF	AAA/1	137,067,750	19.59%
51	SURB10	BFF	AAA/4	78,299,802	11.19%
51	SURB05	BFF	AAA/5	49,124,349	7.02%
51	SURABS1	BFF	AAA/2	34,612,864	4.95%
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ISP	VGSH	*	ALTA	47,936,752	6.85%
1ISP	IEI	*	ALTA	17,984,455	2.57%
				699,553,251	100.00%

TOTAL CARTERA		**699,553,251**	**100.00%**
ACTIVO NETO		**697,521,643**	
VAR ESTABLECIDO $		**4,194,369**	**.60%**
VAR OBSERVADO PROMEDIO $		**1,541,301**	**.22%**
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 0.60% con una probabilidad del 95%.

Composición de las Carteras de los Fondos Origen



Direcciones electrónicas para consultar la Tenencia de Activos Objeto de Inversión:

SUR1E BOE1	https://www.suraim.com.mx/#
SURGOB BOE1	https://www.suraim.com.mx/#
SURCORP BOE1	https://www.suraim.com.mx/#