



INVESTMENT MANAGEMENT

SURUDI

AAAf.mx  
MRA4.mxFONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
MEDIANO PLAZO

| 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+       | 83,378,594    | 3.39%   |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |         |        |              |               |         |
| S                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | UDIBONO | 281130 | mxAAA        | 1,407,880,362 | 57.17%  |
| S                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | UDIBONO | 290830 | mxAAA        | 716,945,201   | 29.11%  |
| S                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | UDIBONO | 311127 | mxAAA        | 76,278,842    | 3.10%   |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |         |        |              |               |         |
| 94                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |         |        |              | 49,715,787    | 2.02%   |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |         |        |              |               |         |
| 91                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |         |        |              | 52,548,569    | 2.13%   |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |         |        |              | 2,386,747,355 | 96.91%  |
| OTROS VALORES                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |         |        |              | 75,980,391    | 3.09%   |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |         |        |              | 75,980,391    | 3.09%   |
| TOTAL CARTERA                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |         |        |              | 2,462,727,746 | 100.00% |
| ACTIVO NETO                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |         |        |              | 2,460,906,264 |         |
| VAR ESTABLECIDO \$                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |         |        |              | 11,078,298    | 0.45%   |
| VAR OBSERVADO PROMEDIO \$                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |         |        |              | 5,020,074     | 0.20%   |
| Cartera al:                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |         |        | 18-Dec-25    |               |         |
| 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 0.45% con una probabilidad del 95%. |         |        |              |               |         |