



INVESTMENT MANAGEMENT

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+	22,797,264	4.03%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91	ENGECB	24	AAA.mx	13,098,763	2.31%
91				34,648,797	6.12%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	270121	HR1	202,054,609	35.68%
BI	CETES	270708	HR1	106,869,084	18.87%
BI	CETES	270318	HR1	91,175,130	16.10%
				470,643,647	83.11%
REPORTO					
IQ	BPAG91	300110	mxAAA	41,322,332	7.30%
LF	BONDESF	261001	mxAAA	41,322,323	7.30%
				82,644,655	14.59%
OTROS VALORES				13,026,974	2.30%
				13,026,974	2.30%
TOTAL CARTERA				566,315,277	100.00%
ACTIVO NETO				565,707,348	
VAR ESTABLECIDO \$				8,494,709	1.50%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				330,824	0.06%
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 1.5% con una probabilidad del 95%					