



INVESTMENT MANAGEMENT

SURREAL

AAf.mx
MRA6.mxFONDO 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 CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M				140,413,931	4.02%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	82,915,050	2.38%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES					
S	UDIBONO	311127	mxAAA	1,879,545,971	53.87%
S	UDIBONO	340824	mxAAA	549,071,790	15.74%
S	UDIBONO	401115	mxAAA	150,847,887	4.32%
S	UDIBONO	351122	mxAAA	114,311,526	3.28%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				119,523,694	3.43%
				3,036,629,848	87.03%
REPORTO					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	165,989,751	4.76%
				165,989,751	4.76%
OTROS VALORES					
				286,470,027	8.21%
				286,470,027	8.21%
TOTAL CARTERA				3,489,089,627	100.00%
ACTIVO NETO				3,457,858,436	
VAR ESTABLECIDO \$				69,129,304	2.00%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				15,942,981	0.46%
Cartera al:			06-Nov-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 2.0% con una probabilidad del 95%.