



INVESTMENT MANAGEMENT

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					
M	BONOS	290301	mxAAA	51,586,782	9.06%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	22,604,742	3.97%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91	ENGECB	24	AAA.mx	13,040,237	2.29%
91				35,111,709	6.17%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	270121	HR1	200,462,935	35.22%
BI	CETES	270708	HR1	106,126,128	18.64%
BI	CETES	270318	HR1	90,474,990	15.89%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC					
D8				15,413,428	2.71%
				534,820,950	93.96%
REPORTO					
LF	BONDESF	261001	mxAAA	13,229,209	2.32%
IQ	BPAG91	300516	mxAAA	13,229,167	2.32%
				26,458,376	4.65%
OTROS VALORES					
				7,941,519	1.40%
				7,941,519	1.40%
TOTAL CARTERA				569,220,844	100.00%
ACTIVO NETO				568,194,974	
VAR ESTABLECIDO \$				8,538,294	1.50%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				530,841	.10%
Cartera al:			31-Oct-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%