



INVESTMENTS

SURGOB

AAAf.mx
MRA2.mxFONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M	BONOS	280302	mxAAA	136,936,095	2.34%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	270318	mxA-1+	1,453,042,500	24.85%
BI	CETES	270513	mxA-1+	958,119,500	16.39%
BI	CETES	271223	mxA-1+	821,674,350	14.05%
BI	CETES	270708	mxA-1+	378,927,440	6.48%
BI	CETES	270401	mxA-1+	289,802,820	4.96%
BI	CETES	270429	mxA-1+	288,295,200	4.93%
BI	CETES	270527	mxA-1+	286,685,460	4.90%
BI	CETES	270624	mxA-1+	285,056,160	4.88%
BI	CETES	280803	mxA-1+	234,442,836	4.01%
BI	CETES	270722	mxA-1+	189,009,720	3.23%
BI	CETES	270915	mxA-1+	186,587,300	3.19%
				5,508,579,381	94.22%
REPORTO					
LF	BONDESF	300124	mxAAA	256,943,457	4.39%
				256,943,457	4.39%
OTROS VALORES					
				80,707,979	1.38%
				80,707,979	1.38%
TOTAL CARTERA				5,846,230,817	100.00%
ACTIVO NETO				5,651,407,831	
VAR ESTABLECIDO \$				5,659,687	.10%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				1,507,015	.03%
Cartera al:				30-Sep-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 0.10% con una probabilidad del 95%.