



INVESTMENT MANAGEMENT

SURRVMX

NA

FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE  
ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>					
1	FEMSA	UBD	ALTA	63,299,730	12.41%
1	GFNORTE	O	ALTA	61,537,749	12.07%
1	WALMEX	*	ALTA	48,575,108	9.53%
1	AMX	B	ALTA	46,275,884	9.08%
1	GMEXICO	B	ALTA	39,197,212	7.69%
1	CEMEX	CPO	ALTA	30,366,358	5.96%
1	BIMBO	A	ALTA	15,931,790	3.12%
1	GAP	B	ALTA	14,654,454	2.87%
1	ASUR	B	ALTA	13,711,693	2.69%
1	AC	*	ALTA	12,419,061	2.44%
1	GFINBUR	O	ALTA	12,395,776	2.43%
1	GCARSO	A1	ALTA	11,652,170	2.29%
1	KOF	UBL	ALTA	11,183,644	2.19%
1				97,471,031	19.12%
<b>TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES</b>					
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	19,237,344	3.77%
				<b>497,909,002</b>	<b>97.65%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				<b>11,981,474</b>	<b>2.35%</b>
				<b>11,981,474</b>	<b>2.35%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>509,890,477</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>509,457,953</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>14,274,201</b>	<b>2.80%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>3,342,417</b>	<b>0.66%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>25-Jan-24</b>		
<p>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 2.80% con una probabilidad del 95%.</p>					