



INVESTMENT MANAGEMENT

SURASIA

NA

FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF / BURS | VALOR TOTAL | % |
|---|----------------------------------|-------|------------------|--------------------|----------------|
| DIRECTO | | | | | |
| TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | |
| 1ISP | VJPA | N | ALTA | 71,260,881 | 33.20% |
| 1ISP | FLXC | N | BAJA | 35,234,425 | 16.42% |
| 1ISP | XMTD | N | BAJA | 24,917,271 | 11.61% |
| 1ISP | FLXI | N | BAJA | 22,045,899 | 10.27% |
| 1ISP | IAUS | N | ALTA | 21,974,237 | 10.24% |
| 1ISP | FLXK | N | BAJA | 19,381,887 | 9.03% |
| 1ISP | EWS | * | MEDIA | 4,384,372 | 2.04% |
| 1ISP | | | | 13,926,600 | 6.49% |
| | | | | 213,125,573 | 99.29% |
| OTROS VALORES | | | | | |
| | | | | 1,520,092 | 0.71% |
| | | | | 1,520,092 | 0.71% |
| | TOTAL CARTERA | | | 214,645,665 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 214,242,272 | |
| | VAR ESTABLECIDO \$ | | | 8,159,649 | 3.80% |
| | VAR OBSERVADO PROMEDIO \$ | | | 3,347,640 | 1.55% |
| | Cartera al: | | 31-May-24 | | |
| <p>Para calcular el límite máximo de VaR, se considera la totalidad de la composición de la cartera. El límite superior o Valor en Riesgo máximo que se presenta en el régimen de inversión se obtiene calculando el quinto peor escenario con base en la metodología histórica, y asumiendo una composición de cartera en los máximos permitidos. El límite autorizado del VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 3.80% con una probabilidad del 95%.</p> | | | | | |

Direcciones electrónicas para consultar la Tenencia de Activos Objeto de Inversión:

EWJ *

<http://www.bloomberg.com/quote/EWJ:US>

EWA *

<http://www.bloomberg.com/quote/EWA:US>