



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>