



INVESTMENT MANAGEMENT

SURPAT

NA

FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE
ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					
1	GMEXICO	B	ALTA	327,250,438	8.46%
1	GFNORTE	O	ALTA	325,820,091	8.42%
1	AMX	B	ALTA	317,655,803	8.21%
1	FEMSA	UBD	ALTA	301,264,995	7.79%
1	WALMEX	*	ALTA	297,556,950	7.69%
1	CEMEX	CPO	ALTA	271,050,567	7.01%
1	GAP	B	ALTA	181,021,817	4.68%
1	AC	*	ALTA	151,297,429	3.91%
1	ASUR	B	ALTA	150,383,438	3.89%
1	BIMBO	A	ALTA	106,017,145	2.74%
1	GRUMA	B	ALTA	96,241,914	2.49%
1	KOF	UBL	ALTA	94,156,983	2.43%
1				829,825,230	21.46%
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES					
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	261,965,555	6.77%
				3,711,508,356	95.97%
REPORTO					
LF	BONDEF	261231	mxAAA	94,887,064	2.45%
				94,887,064	2.45%
OTROS VALORES					
				60,951,810	1.58%
				60,951,810	1.58%
TOTAL CARTERA				3,867,347,231	100.00%
ACTIVO NETO				3,866,184,734	
VAR ESTABLECIDO \$				185,639,533	4.80%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				13,801,883	0.36%
Cartera al:			11-Dec-24		

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).