

PRINLS1			
Fondo de Inversión en Instrumentos de Renta Variable			
DISCRECIONAL			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
Bonos Gob. Fed. Tasa fija			
M BONOS 290301 AAA(mex)		49,868	5.06
M BONOS 530731 AAA(mex)		18,164	1.84
M BONOS 270603 AAA(mex)		11,478	1.17
M BONOS 280302 AAA(mex)		7,315	0.74
M BONOS 341123 AAA(mex)		5,123	0.52
CPOs sobre Acciones del IPC			
1B NAFTRA ISHRS Alta		22,764	2.31
1B IVPESO ISHRS Media		6,213	0.63
Chequera dolares			
CHD 40-002 9079993 N/A		121	0.01
Soc. de Inv. de Renta Variable			
52 PRINRVA FFX N/A		91,003	9.24
52 GLREITS FFX N/A		19,910	2.02
52 PEMERGE FFX N/A		15,684	1.59
Sociedad de Inversión de Deuda			
51 PRINFMP FFX AAA/S3(r)		245,065	24.88
51 PRINFTR FFX AAA/S5(r)		98,047	9.96
51 PRINMAS FFX AAA/S3(r)		68,490	6.95
51 PRINGLP FFX AAA/S5(r)		39,709	4.03
51 PRINFGU FFX AAA/S2(r)		29	0.00
TRAC Tit. ref. acciones extr.			
11SP IVV * N/A		74,086	7.52
11SP CBU7 N N/A		36,875	3.74
11SP RSP * N/A		16,555	1.68
11SP EWJ * N/A		13,436	1.36
11SP MEXS N N/A		7,982	0.81
11SP EDV * N/A		7,238	0.73
11SP VVK * N/A		6,457	0.66
11SP LQDA N N/A		3,573	0.36
11SP CBU0 N N/A		2,638	0.27
Udibonos UDIS			
S UDIBONO 261203 AAA(mex)		45,039	4.57
S UDIBONO 281130 AAA(mex)		20,006	2.03
S UDIBONO 311127 AAA(mex)		10,000	1.02
Reportos			
1M BPAG28 270506 AAA(mex)		7,744	0.79
Varios			
11 IDTXX N Alta		34,240	3.48
		984,851	100
Principal SAM I, SA. DE CV. Fondo de Inv. De Renta Variable VAR ESTAB: 1.130% VAR PROM: 0.408%			

Udibonos UDIS	20.001%
TRAC Tit. ref. acciones extr.	18.446%
Bonos Gob. Fed. Tasa fija	17.716%
Acciones Ind., Com. y de Serv.	8.994%
Cetes	8.749%
Certificado Bursatil	7.570%
Reportos	4.253%
Varios	3.477%
CPOs sobre Acciones del IPC	2.993%
Bonos Prot. Ahorro pago Trim.	2.015%
Empresas del Dow Jones SP	1.886%
Eurobonos a Mediano Plazo MXP	1.333%
Bonos Prot. Ahorro pago mensual	1.083%
Cert. Bursatiles Bancarios	0.909%
Notas Estruct. Int. a descuento	0.332%
Acciones Instit. de credito	0.085%
Cert. Burs. Fiduc. Inmob.	0.057%
Chequera dolares	0.012%
Bondes D	0.000%

GMP+			
Fondo de Inversión de Renta Variable			
CLASIF: RENTA VARIABLE DISCRECIONAL			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)			
11SP VAGU N ALTA		201,025	26.52
11SP VNRA N ALTA		183,131	24.16
11SP VDEA N ALTA		82,504	10.88
11SP VDPA N ALTA		81,874	10.80
11SP VWCG N ALTA		81,691	10.78
11SP VDTA N ALTA		44,207	5.83
11SP VFEA N ALTA		37,472	4.94
11SP VJPA N ALTA		29,958	3.95
11SP VAPU N ALTA		15,496	2.04
OTROS VALORES			
		763	0.10
		758,122	100
GBM RETORNO ABSOLUTO, S.A. DE C.V. VAR ESTAB: 2.120% VAR PROM: 1.245%			

SURUSD			
Sociedad de Inversión de Renta Variable			
CLASIFICACIÓN: ESPECIALIZADA EN DEUDA			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
VALORES GUBERNAMENTALES			
D1SP MEXG29 260121 BBB-		46,962	9.96
D1SP MEXC46 270328 BBB-		42,887	9.09
D1SP MEXF76 290422 BBB-		29,962	6.35
D1SP MEXE02 280111 BBB-		28,400	6.02
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES			
CHD BACMEX 5193582		70,726	15.00
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS			
11SP VCSH * ALTA		88,859	18.84
11SP VGIT * ALTA		46,786	9.92
11SP VGSH * ALTA		40,053	8.49
11SP IEI * ALTA		39,197	8.33
11SP VCIT * MEDIA		10,144	2.15
11SP		13,463	2.85
REPORTO			
LF BONDEF 310320 mxAAA		16,974	3.60
		471,569	100
SURA USD, S.A. DE C.V. S.I.R.V. VAR ESTAB: 2.13% VAR PROM: 0.42%			

FT-GLOB			
Fondo de Inversión de Renta Variable			
CLASIF: ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
ACCIONES DEL SIC (TIPO DE CAMBIO CIERRE)			
1ASP SNPS * ALTA		12,365	5.95
1ASP SHOP N ALTA		12,197	5.87
1ASP TYL * ALTA		12,052	5.80
1ASP PGHN N ALTA		11,990	5.77
1ASP ZS * ALTA		11,949	5.75
1ASP MA * ALTA		11,922	5.74
1ASP MELI N ALTA		11,593	5.58
1ASP AMS N ALTA		10,263	4.94
1ASP ISRG * ALTA		10,173	4.90
1ASP DJN9 N ALTA		10,051	4.84
1ASP SIKA N ALTA		9,444	4.55
1ASP ONTO * ALTA		9,107	4.38
1ASP PLNT * ALTA		8,276	3.98
1ASP ICE * ALTA		8,230	3.96
1ASP ZBRA * ALTA		7,756	3.73
1ASP VLTO * ALTA		7,570	3.64
1ASP 4568 N ALTA		7,039	3.39
1ASP CRL * ALTA		6,904	3.32
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)			
11SP ACWI * ALTA		27,418	13.20
OTROS VALORES			
		1,491	0.72
		207,789	100
FT-GLOB FRANKLIN GLOBAL GROWTH FUND, S.A. DE C.V. VAR ESTAB: 3.50% VAR PROM: 1.633%			

VXUDIMP			
Fondo de Inv. De Inst. de Deuda en Tasa Real			
clasificación: IDMPGUBUDIS			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
VALORES GUBERNAMENTALES			
S UDIBONO 261203 mxAAA		306,681	60.61
S UDIBONO 281130 mxAAA		102,254	20.21
S UDIBONO 251204 mxAAA		66,258	13.09
REPORTOS			
1M BPAG28 251106 mxAAA		30,827	6.09
		506,020	100
FONDO VALMEX17 INST DE DEUDA EN TASA REAL, S.A. DE C.V. VAR ESTAB: 0.683 VAR PROM: 0.230%			

FT-BOND			
Fondo de Inversión de Renta Variable			
Clasificación: Especializada en deuda			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)			
11SP IBTA N ALTA		1,384,337	25.14
11SP CBU7 N ALTA		1,175,390	21.34
11SP SDJA N ALTA		1,130,158	20.52
11SP CBU0 N ALTA		533,444	9.69
11SP LODA N ALTA		495,833	9.00
11SP FLOA N ALTA		274,152	4.98
11SP XGLU N ALTA		169,809	3.08
11SP VDST N ALTA		165,751	3.01
11SP BBSM N ALTA		112,053	2.03
OTROS VALORES			
		65,848	1.20
		5,506,775	100
TEMPLETON ASIAN GROWTH FUND, S.A. DE C.V. VAR ESTAB: 2.00% VAR PROM: 1.355%			

STERNDQ			
Fondo de Inversión de Renta Variable			
Clasificación: Especializada en acciones internacionales			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTO			
MC BONOS 271202 mxAAA		10,900	0.49
ACCIONES DEL SIC (SPOT)			
1ASP VARIOS		129,712	5.80
TRACKS EXTRANJEROS (SPOT)			
11SP QQQM * ALTA		2,083,993	93.24
INVERSION EN DOLARES			
CHD BSANT 2945000		10,551	0.47
		2,235,155	100
FONDO SAM RENTA VARIABLE 25, S.A. DE C.V. FRV VAR ESTAB: 4.110 % VAR PROM: 2.085%			

SURASTA			
Fondo de Inversión de Renta Variable			
CLASIF: ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)			
11SP VJPA N ALTA		118,419	33.49
11SP CEMA N ALTA		41,319	11.69
11SP IAUS N MEDIA		37,754	10.68
11SP XMTD N BAJA		37,227	10.53
11SP FLXC N NULA		34,528	9.77
11SP FLXI N NULA		24,658	6.97
11SP FLXK N BAJA		17,303	4.89
11SP EPI * MEDIA		13,039	3.69
11SP C300 N BAJA		7,808	2.21
11SP		18,490	5.23
OTROS VALORES			
		3,014	0.85
		353,559	100
SURA ASIA, S.A. DE C.V. VAR ESTAB: 3.80% VAR PROM: 0.52%			

VTLS-RV			
Fondo de Inversión de Renta Variable DISCRECIONAL			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			
1 TEAK	CPO Baja	2,275	0.27
Chequera Dolares			
CHD 40-133	8152191	0	0.00
Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			
IASP SAP	N Alta	39,790	4.71
IASP NVDA	* Alta	30,702	3.63
IASP MSCI	* Alta	27,834	3.29
IASP TSM	N Alta	27,398	3.24
IASP BKNG	* Alta	26,360	3.12
IASP META	* Alta	25,915	3.07
IASP JPM	* Alta	25,706	3.04
IASP MA	* Alta	25,409	3.01
IASP AZO	* Alta	25,366	3.00
IASP CSU	N Alta	24,853	2.94
IASP AAPL	* Alta	24,532	2.90
IASP ABBN	N Alta	24,495	2.90
IASP CIB	N Alta	24,312	2.88
IASP IBE	N Alta	24,113	2.85
IASP GIS	* Alta	24,022	2.84
IASP ACN	N Alta	23,747	2.81
IASP SHEL	N Alta	23,744	2.81
IASP GOOGL	* Alta	22,596	2.67
IASP ZTS	* Alta	22,494	2.66
IASP TMO	* Alta	22,207	2.63
IASP ANET	* Alta	22,164	2.62
IASP CRM	* Alta	21,811	2.58
IASP AMZN	* Alta	18,908	2.24
IASP IQV	* Alta	17,825	2.11
IASP DAL	* Alta	17,821	2.11
IASP AD	N Alta	16,315	1.93
IASP ULTA	* Alta	16,142	1.91
IASP KEYS	* Alta	14,301	1.69
IASP RMD	* Alta	14,026	1.66
IASP RYAAY	N Alta	13,798	1.63
IASP HON	* Alta	13,073	1.55
IASP CDW	* Alta	4,687	0.55
Titulos Ref. a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			
1ISP SPY	* Alta	69,585	8.23
1ISP ACWX	* Alta	45,462	5.38
1ISP XLV	* Alta	19,111	2.26
Reportos			
LD BONDESD	251211 AAA(mex)	2,164	0.26
		845,062	100
ACTINVER VITALIS RF, S.A. DE C.V.			
VAR ESTAB: 3.690 %		VAR PROM: 1.222%	

VTLS-RF			
Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda DISCRECIONAL			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			
M BONOS	341123 AAA(mex)	160,022	10.53
M BONOS	330526 AAA(mex)	50,474	3.32
M BONOS	300228 AAA(mex)	34,822	2.29
M BONOS	290301 AAA(mex)	33,662	2.21
M BONOS	260903 AAA(mex)	15,024	0.99
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			
CD BANOB	21UX AAA (mex)	27,260	1.79
CD BANOB	19UX AAA (mex)	14,453	0.95
Certificados Bursátiles Corporativos			
91 FIBRAHD	19U HR AA	43,435	2.86
91 RCO	18U AAA (mex)	28,242	1.86
91 ELEKTRA	22U HR AA	26,425	1.74
91 XIGNUX	24-2 Aaa,mx	26,290	1.73
91 OSM	15U mxAA-	23,310	1.53
91 ARA	21-2X AA- (mex)	22,380	1.47
91 FUNO	16U AAA (mex)	22,285	1.47
91 GAP	23-2L mxAAA	21,639	1.42
91 MEDICA	20 AA (mex)	20,604	1.36
91 ORBIA	22-2L AAA (mex)	20,059	1.32
91 LAMOSA	19 AA (mex)	18,839	1.24
91 ELEKTRA	22-2U HR AA	18,801	1.24
91 AGUA	17-2X mxAA-	18,731	1.23
91 STORAGE	21V AA- (mex)	16,375	1.08
91 VWLEASE	24-2 mxAAA	15,835	1.04
91 FUNO	23-2L AAA (mex)	14,542	0.96
91 FIHO	19 AA- (mex)	13,399	0.88
91 CMPC	23L AAA (mex)	11,605	0.76
91 GAP	22-2L mxAAA	9,135	0.60
91 EDUCA	23-2L HR AA	8,764	0.58
91 DANHOS	16 AAA (mex)	7,304	0.48
91 FUNO	23-2L AAA (mex)	7,005	0.46
91 FUNO	13U AAA (mex)	6,519	0.43
91 GHEMA	23 HR BBB+	6,041	0.40
91 DANHOS	17 AAA (mex)	5,246	0.35
91 FSHOP	19U A+ (mex)	4,987	0.33
91 NM	15 mxAA+	4,003	0.26
91 FUNO	15 AAA (mex)	2,923	0.19
91 ACOSTCB	15 AAA (mex)	2,558	0.17
91 ALSEA	19-2 A+ (mex)	1,879	0.12
91 TENIXCB	14U AAA (mex)	1,734	0.11
91 GHOCB	14 HR D	1,369	0.09
91 RCO	12U AAA (mex)	1,228	0.08
91 OSM	15 mxAA-	745	0.05
91 CAMSCB	13U AAA (mex)	610	0.04
91 DMXI	15 mxD	182	0.01
Certificados De La Tesorería De La Federación			
BI CETES	260416 AAA(mex)	44,972	2.96
BI CETES	260611 AAA(mex)	15,369	1.01
Titulos Referenciados a Acciones			
1ISP SHV	*	29,092	1.91
Titulos de Organismos Financieros Multilaterales			
J1 CABEI	2-23S mxAAA	14,482	0.95
Udibonos			
S UDIBONO	431112 AAA(mex)	321,375	21.14
S UDIBONO	340824 AAA(mex)	198,738	13.07
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			
95 FEFA	24B mxAAA	22,631	1.49
95 FOVISCB	19U Aaa,mx	11,616	0.76
95 FEFA	24V mxAAA	10,540	0.69
95 PEMEX	14U mxAAA	7,027	0.46
95 FOVISCB	17-2U Aaa,mx	5,974	0.39
95 FOVISCB	19-2U AAA (mex)	3,941	0.26
95 TFOVIS	14U AAA (mex)	1,360	0.09
Reportos			
LF BONDESD	250619 AAA(mex)	42,416	2.79
		1,520,282	100
ACTINVER VITALIS RF, S.A. DE C.V.			
VAR ESTAB: 1.200 %		VAR PROM: 0.563%	

STER-OP			
Sociedad de Inversión de Renta Variable CLASIFICACIÓN: DISCRECIONAL			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
TITULOS RECIBIDOS EN REPORTE			
MC BONOS	270603 mxAAA	68,869	2.11
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES			
1 AMX	B ALTA	281,570	8.62
SERVICIOS FINANCIEROS			
CF VARIOS	* ALTA	25,598	0.78
1 GENTERA	* ALTA	155,298	4.75
1 GFNORTE	O ALTA	365,195	11.18
1 VARIOS		17,208	0.53
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE			
1 AC	* ALTA	238,668	7.31
1 FEMSA	UBD ALTA	267,574	8.19
1 GRUMA	B ALTA	70,866	2.17
1 KOF	UBL ALTA	96,891	2.97
1 WALMEX	* ALTA	189,508	5.80
INDUSTRIAL			
1 ALFA	A ALTA	189,444	5.80
1 ASUR	B ALTA	98,718	3.02
1 GAP	B ALTA	246,278	7.54
1 PINFRA	* ALTA	93,646	2.87
1 VARIOS		168,324	5.15
MATERIALES			
1 CEMEX	CPO ALTA	218,780	6.70
1 GMEXICO	B ALTA	340,757	10.43
1 PEROLES	* ALTA	133,060	4.07
		3,266,253	100
FONDO SAM RENTA VARIABLE 20, S.A. DE C.V. FIRV			
VAR ESTAB: 3.400 %		VAR PROM: 1.826%	

FT-EURO			
Fondo de Inversión de Renta Variable CLASIFICACIÓN: ESPEC EN ACCS INTERNACIONALES			
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)			
1ISP 11SP	+ ALTA	47,776	99.07
OTROS VALORES			
		450	0.93
		48,226	100
FRANKLIN MUTUAL BEACON FUND, S.A. DE C.V.			
VAR ESTAB: 3.00 %		VAR PROM: 1.355%	



FT-CORP		AAA/53(mex)		
Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda Clasificación: Largo Plazo				
TIPO DE VALOR	CAL/BUR	IMPORTE	%	
BONOS DE DESARROLLO DEL GOB. FED. BONDES F				
LF		8,007	2.27	
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				
94	BLADEX 24	mxAAA	10,078	2.85
94			11,712	3.32
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DES.				
CD	KEXIM 21	AAA,mx	18,109	5.13
CD	KDB 22V	AAA,mx	11,476	3.25
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				
91	VWLEASE 24	mxAAA	27,221	7.71
91	PCARFM 24	mxAAA	20,128	5.70
91	GBM 21	HR AA+	19,985	5.66
91	GMFIN 22	mxAAA	18,091	5.12
91	ORBIA 22L	AAA(mex)	18,082	5.12
91	MEGA 22	AAA(mex)	18,030	5.11
91	HERDEZ 22-2L	mxAA	16,046	4.54
91	FUNO 21-2X	AAA(mex)	15,537	4.40
91	LAB 23-2	AA+(mex)	15,084	4.27
91	CETEMEM 22-3	mxAAA	10,669	3.02
91	CMPC 23V	AAA(mex)	10,025	2.84
91	NAVISTS 22	mxAAA+	10,021	2.84
91	FUNO 23-2L	AAA(mex)	7,548	2.14
91	GAP 25	mxAAA	7,448	2.11
91			29,713	8.42
CERT. BUR. EMITIDOS POR ENT. O INST. DEL GOB. FED.				
95	FNCOT 22S	AAA,mx	10,079	2.85
95	CFE 21-4	mxAAA	10,025	2.84
95			11,613	3.29
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				
D8	GSF0325	FLOAT A2	7,540	2.14
REPORTO				
LF	BONDES F	340323 mxAAA	10,817	3.06
		353,086	100	
TEMPLETON EMERGING MARKETS BOND FUND, S.A. DE C.V. VAR ESTAB: 0.10% VAR PROM: 0.018%				

Metodología en cálculo de VaR

SURVEUR	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
SURUSD	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
SURASIA	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
SURREAL	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
VXUDIMP	La metodología utilizada para calcular el VaR es PPG-Real3A + 0.45%, con un nivel de confianza de 97.5%.
VXGUBLP	Modelo Historico que incluye 280 datos, horizonte temporal de 1 día y nivel de confianza del 97.5% .
FT-USA 1	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
FT-EURO	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
TEMBIA	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
FT-GLOB	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
FT-BOND	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
FT-CORP	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
GBMCRE	Método Delta normal, Un periodo de muestra de un año, con un nivel de confianza fijado al 95% y horizonte temporal de 1 día
GBMGMP+	Método Delta normal, Un periodo de muestra de un año, con un nivel de confianza fijado al 95% y horizonte temporal de 1 día
PRINLS1	Método de simulación Monte Carlo, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 250 observaciones
PRINLS2	Método de simulación Monte Carlo, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 250 observaciones
PRINLS3	Método de simulación Monte Carlo, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 250 observaciones
STER-OP	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
STERNDQ	Metodo Historico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.
VTLS-RF	Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y con una muestra de 252 observaciones.
VTLS-RV	Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y con una muestra de 252 observaciones.

se actualiza el último día hábil de cada semana*

Mantente ágil

55 52 30 02 00 / 800 426 6639