

COMMODQ - VECTOR FONDO QUANT COMMODITIES, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ASP	TTE	N	ALTA	2,341	2,966,080.06	4.43
1ASP	EOG	*	ALTA	1,096	2,376,365.39	3.55
1ASP	XOM	*	ALTA	1,144	2,332,280.53	3.48
1ASP	FANG	*	ALTA	668	2,282,784.87	3.41
1ASP	CHK1	*	ALTA	1,439	2,273,185.58	3.39
1ASP	SUU	N	ALTA	3,294	2,261,480.15	3.37
1ASP	BP	N	ALTA	3,505	2,222,636.67	3.32
1ASP	BHP	N	ALTA	2,032	2,170,012.57	3.24
1ASP	DVN	*	ALTA	2,590	2,166,399.17	3.23
1ASP	SHEL1	N	ALTA	1,708	2,146,339.45	3.20
1ASP	CHRD	*	ALTA	713	2,142,198.00	3.20
1ASP	VALE	N	ALTA	10,245	2,129,522.85	3.18
1ASP	MUR	*	ALTA	2,905	2,079,636.52	3.10
1ASP	OXY1	*	ALTA	1,935	2,079,577.49	3.10
1ASP	CTRA	*	ALTA	4,167	2,061,768.45	3.08
1ASP	BG	N	ALTA	1,096	2,060,915.19	3.08
1ASP	CVX	*	ALTA	724	2,019,447.00	3.01
1ASP	GOLD	N	ALTA	6,516	2,018,799.45	3.01
1ASP	LNG	*	ALTA	665	1,908,408.94	2.85
1ASP	RIO	N	ALTA	1,512	1,871,639.06	2.79
1ASP	RS	*	ALTA	359	1,858,733.87	2.77
1ASP	TKR	*	ALTA	1,227	1,837,984.03	2.74
1ASP	COP	*	ALTA	906	1,818,382.61	2.71
1ASP	INGR	*	ALTA	854	1,775,580.32	2.65
1ASP	GGB	N	ALTA	30,137	1,768,227.24	2.64
1ASP	NUE	*	ALTA	559	1,633,309.82	2.44
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BRNT	N	ALTA	5,615	5,087,371.17	7.59
1ISP	SGOL	*	ALTA	6,178	2,504,217.37	3.74
1ISP	IAU	*	ALTA	2,951	2,367,004.19	3.53
1ISP	CRUD	N	ALTA	11,662	2,038,651.21	3.04
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					66,258,939.22	98.87
OTROS VALORES				7,310	755,554.96	1.13
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					67,014,494.18	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE

CALIFICACIÓN
mxAAA

VaR Promedio
1.325%

Límite de VaR
5.000%

El VAR o Valor en Riesgo (Value at Risk por sus siglas en inglés) se calcula siguiendo una metodología de simulación Monte Carlo con un 95% de confiabilidad, el número de simulaciones efectuadas son 1,000, con un horizonte de tiempo de 1 día y los factores de riesgo utilizados corresponden a un año de historia.