

COMMODQ - VECTOR FONDO QUANT COMMODITIES, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 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 | 2,376 | 2,947,938.33 | 4.30 |
| 1ASP | EOG | * | ALTA | 1,170 | 2,472,665.49 | 3.61 |
| 1ASP | FANG | * | ALTA | 701 | 2,370,139.56 | 3.46 |
| 1ASP | XOM | * | ALTA | 1,189 | 2,365,742.76 | 3.45 |
| 1ASP | VALE | N | ALTA | 11,225 | 2,295,139.94 | 3.35 |
| 1ASP | CHK1 | * | ALTA | 1,479 | 2,281,976.35 | 3.33 |
| 1ASP | SUU | N | ALTA | 3,294 | 2,281,562.50 | 3.33 |
| 1ASP | DVN | * | ALTA | 2,733 | 2,276,040.37 | 3.32 |
| 1ASP | BHP | N | ALTA | 2,232 | 2,254,581.02 | 3.29 |
| 1ASP | CHRD | * | ALTA | 713 | 2,243,150.73 | 3.27 |
| 1ASP | BP | N | ALTA | 3,505 | 2,234,420.94 | 3.26 |
| 1ASP | BG | N | ALTA | 1,196 | 2,183,427.93 | 3.19 |
| 1ASP | OXY1 | * | ALTA | 2,029 | 2,151,779.86 | 3.14 |
| 1ASP | CVX | * | ALTA | 780 | 2,148,072.31 | 3.13 |
| 1ASP | SHEL1 | N | ALTA | 1,708 | 2,109,287.08 | 3.08 |
| 1ASP | MUR | * | ALTA | 2,905 | 2,109,231.25 | 3.08 |
| 1ASP | GOLD | N | ALTA | 7,232 | 2,097,182.64 | 3.06 |
| 1ASP | TKR | * | ALTA | 1,412 | 2,081,806.06 | 3.04 |
| 1ASP | CTRA | * | ALTA | 4,257 | 2,060,103.05 | 3.01 |
| 1ASP | GGB | N | ALTA | 34,535 | 2,027,548.88 | 2.96 |
| 1ASP | RS | * | ALTA | 396 | 2,021,063.30 | 2.95 |
| 1ASP | RIO | N | ALTA | 1,625 | 1,932,890.08 | 2.82 |
| 1ASP | COP | * | ALTA | 966 | 1,909,256.43 | 2.79 |
| 1ASP | INGR | * | ALTA | 939 | 1,873,418.58 | 2.73 |
| 1ASP | UMC | N | ALTA | 12,854 | 1,853,928.56 | 2.70 |
| 1ASP | NUE | * | ALTA | 591 | 1,693,262.62 | 2.47 |
| TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | | |
| 1ISP | BRNT | N | ALTA | 5,615 | 4,935,796.13 | 7.20 |
| 1ISP | SGOL | * | ALTA | 6,323 | 2,385,055.11 | 3.48 |
| 1ISP | IAU | * | ALTA | 3,001 | 2,240,039.79 | 3.27 |
| 1ISP | CRUD | N | ALTA | 11,662 | 1,983,778.56 | 2.89 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 67,820,286.21 | 98.93 |
| OTROS VALORES | | | | 7,096 | 730,602.24 | 1.07 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 68,550,888.45 | 100.00 |

CATEGORÍA
ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE

CALIFICACIÓN
mxAAA

VaR Promedio
1.290%

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.