

**COMMODQ - VECTOR FONDO QUANT COMMODITIES, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TITULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1ASP	CVX	*	ALTA	2,479	5,965,850.15	3.31
1ASP	MPC	*	ALTA	4,499	5,903,924.89	3.28
1ASP	SNP	N	ALTA	6,108	5,825,833.76	3.23
1ASP	XOM	*	ALTA	4,710	5,910,361.99	3.28
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	AMCR	N	ALTA	24,100	5,935,711.31	3.29
1ASP	LIN	N	ALTA	842	6,008,999.62	3.33
1ASP	SHW	*	ALTA	831	6,001,416.52	3.33
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	ALLE	N	ALTA	2,166	5,882,884.81	3.26
1ASP	AME	*	ALTA	2,009	6,057,984.41	3.36
1ASP	ECL	*	ALTA	1,230	5,917,350.94	3.28
1ASP	FAST	*	ALTA	4,475	5,878,854.26	3.26
1ASP	GD	*	ALTA	1,385	5,921,149.96	3.29
1ASP	HON	*	ALTA	1,390	5,943,666.17	3.30
1ASP	IEX	*	ALTA	1,218	5,902,832.86	3.28
1ASP	INFO	N	ALTA	2,181	5,945,093.90	3.30
1ASP	ITW	*	ALTA	1,155	5,845,744.91	3.24
1ASP	MMM	*	ALTA	1,619	5,897,607.76	3.27
1ASP	ROP	*	ALTA	594	5,991,570.46	3.33
1ASP	RSGA	*	ALTA	2,049	5,859,670.52	3.25
1ASP	WMI	*	ALTA	1,747	5,979,459.96	3.32
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	CTAS	*	ALTA	639	5,807,429.31	3.22
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	GIS	*	ALTA	4,271	5,901,647.94	3.28
1ASP	KHC	*	ALTA	8,055	5,930,246.06	3.29
1ASP	MDLZ	*	ALTA	4,384	5,961,592.59	3.31
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	DBP	*	ALTA	5,979	6,009,328.93	3.34
1ISP	GLD	*	ALTA	1,710	5,995,195.36	3.33
1ISP	GLTR	*	ALTA	3,241	5,945,449.84	3.30
1ISP	IAU	*	ALTA	8,401	5,997,188.90	3.33
1ISP	SGOL	*	ALTA	16,659	5,999,100.81	3.33
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	AVGO	*	ALTA	427	5,826,797.41	3.23
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					177,949,946.31	98.76
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					177,949,946.31	98.76
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	220407	mxAAA	227,334	2,241,516.82	1.24
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					2,241,516.82	1.24
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					180,191,463.13	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE

CALIFICACIÓN
N/A

VaR Promedio
1.681%

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.