

VECTFI - VECTOR FONDO FI, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTO DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IS	BPA182	210909	mxAAA	50,000	5,032,532.20	1.31
M	BONOS	290531	mxAAA	15,000	1,722,955.38	0.45
M	BONOS	310529	mxAAA	700,000	76,472,877.60	19.85
M	BONOS	471107	mxAAA	50,000	5,220,354.20	1.36
PAPEL PRIVADO						
EAIM	INVER-D	0008957		2,439,342	2,439,342.00	0.63
91	METROCB	02	CC(mex)	80,000	179,200.00	0.05
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					91,067,261.38	23.64
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					91,067,261.38	23.64
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	2,609,328	262,239,741.22	68.08
IS	BPA182	230907	mxAAA	315,795	31,890,471.99	8.28
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					294,130,213.21	76.36
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					385,197,474.59	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/3 S&P

VaR Promedio
0.301%

Limite de VaR
0.700%

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 255 datos.

Lic. Luis Alfredo de Urquijo Hernandez