

VECTRF - VECTOR FONDO RF, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTO DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 24 SEPTIEMBRE, 2020

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IS	BPA182	260903	mxAAA	2,821,611	283,146,302.11	21.24
LD	BONDESD	240425	mxAAA	502,147	50,006,342.17	3.75
LD	BONDESD	250814	mxAAA	5,037,024	500,063,556.83	37.51
LD	BONDESD	250814	mxAAA	5,037,024	500,063,556.83	37.51
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,333,279,757.94	100.00
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					1,333,279,757.94	100.00

CATEGORÍA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/1 S&P

VaR Promedio
0.000%

Límite de VaR
0.030%

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.