

**VECTRF - VECTOR FONDO RF, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTO DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TITULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
93	TOYOTA	02221	mxA-1+	20,000	2,011,282.18	0.06
93	TOYOTA	02421	mxA-1+	287,647	28,870,089.26	0.88
93	VWLEASE	09921	mxA-1+	320,000	31,950,269.76	0.98
93	VWLEASE	10721	mxA-1+	450,000	44,722,619.10	1.37
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					107,554,260.30	3.29
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					107,554,260.30	3.29
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	220407	mxAAA	30,433,224	300,072,067.89	9.18
IM	BPAG28	241107	mxAAA	3,868,000	386,392,220.70	11.82
IS	BPA182	260903	mxAAA	6,026,355	614,699,026.31	18.80
IS	BPA182	260903	mxAAA	449,487	45,848,480.76	1.40
LD	BONDESD	240404	mxAAA	5,004,630	500,227,049.95	15.30
LD	BONDESD	260212	mxAAA	5,029,397	500,227,060.54	15.30
LD	BONDESD	260212	mxAAA	5,029,397	500,227,060.54	15.30
LF	BONDESF	241128	mxAAA	2,008,783	200,090,798.98	6.12
LF	BONDESF	261001	mxAAA	1,147,572	113,834,799.03	3.48
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,161,618,564.70	96.71
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,269,172,825.00	100.00

CATEGORÍA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/1 S&P

VaR Promedio
0.001%

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.

Lic. Luis Alfredo de Urquijo Hernandez