



**VECTRF - VECTOR FONDO RF, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTO DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2020**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IQ	BPAG91	250102	mxAAA	1,784,795	179,966,076.66	12.94
IS	BPA182	270121	mxAAA	101,782	10,232,889.00	0.74
LD	BONDESD	221110	mxAAA	5,006,022	500,063,591.67	35.97
LD	BONDESD	221110	mxAAA	5,006,022	500,063,591.67	35.97
LD	BONDESD	230309	mxAAA	2,005,123	200,025,345.27	14.39
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,390,351,494.27	100.00
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					1,390,351,494.27	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