

**VECTIND - VECTOR FONDO DE INDICE, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE  
CARTERA DE VALORES AL 11 AGOSTO, 2022**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TITULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS MATERIALES</b>						
1	CEMEX	CPO	ALTA	291,829	2,635,215.87	3.83
1	GCC	*	ALTA	3,579	451,490.85	0.66
1	GMEXICO	B	ALTA	67,775	5,662,601.25	8.24
1	PE&OLES	*	ALTA	2,791	511,534.48	0.74
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	ALFA	A	ALTA	66,134	931,166.72	1.35
1	ASUR	B	ALTA	4,428	1,897,575.12	2.76
1	GAP	B	ALTA	7,797	2,311,732.53	3.36
1	GCARSO	A1	ALTA	10,155	810,369.00	1.18
1	OMA	B	ALTA	6,148	845,227.04	1.23
1	ORBIA	*	ALTA	21,833	938,819.00	1.37
1	PINFRA	*	ALTA	4,715	687,494.15	1.00
1	SITES1	A-1	ALTA	20,660	453,073.80	0.66
1	VESTA	*	ALTA	14,781	575,572.14	0.84
1	VOLAR	A	ALTA	18,795	400,145.55	0.58
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	ALSEA	*	ALTA	11,316	438,721.32	0.64
1	ELEKTRA	*	ALTA	1,317	1,517,276.19	2.21
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	4,458	403,716.48	0.59
<b>EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>						
1	AC	*	ALTA	9,551	1,326,920.43	1.93
1	BIMBO	A	ALTA	27,234	2,078,498.88	3.02
1	CUERVO	*	ALTA	12,197	543,376.35	0.79
1	FEMSA	UBD	ALTA	41,529	5,306,575.62	7.72
1	GRUMA	B	ALTA	4,355	1,016,979.60	1.48
1	KIMBER	A	ALTA	32,184	897,611.76	1.31
1	KOF	UBL	ALTA	11,854	1,470,370.16	2.14
1	WALMEX	*	ALTA	114,031	8,179,443.63	11.90
<b>EMPRESAS DE SALUD</b>						
1	LAB	B	ALTA	17,233	292,444.01	0.43
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
1	BOLSA	A	ALTA	10,741	402,787.50	0.59
1	GFINBUR	O	ALTA	45,930	1,681,497.30	2.45
1	GFNORTE	O	ALTA	55,295	6,710,601.20	9.76
1	Q	*	ALTA	4,590	415,716.30	0.60
1	R	A	ALTA	2,940	319,842.60	0.47
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	55,035	2,663,143.65	3.88
41	BBAJIO	O	ALTA	17,524	821,700.36	1.20
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>						
1	AMX	L	ALTA	502,242	9,678,203.34	14.08
1	MEGA	CPO	ALTA	6,716	308,264.40	0.45
1	TLEVISA	CPO	ALTA	57,103	1,677,115.11	2.44
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					67,262,823.69	97.87
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					67,262,823.69	97.87
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
IS	BPA182	280928	mxAAA	3,359	344,879.18	0.50
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					344,879.18	0.50
<b>OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES</b>						
<b>PRESTAMISTA</b>						
1	BIMBO	A	ALTA	1,847	140,963.04	0.21
1	BIMBO	A	ALTA	1,500	114,480.00	0.17
1	BIMBO	A	ALTA	1,335	101,887.20	0.15
1	BIMBO	A	ALTA	1,335	101,887.20	0.15
1	CEMEX	CPO	ALTA	12,500	112,875.00	0.16
1	CEMEX	CPO	ALTA	15,000	135,450.00	0.20
1	CEMEX	CPO	ALTA	22,123	199,770.69	0.29
1	GMEXICO	B	ALTA	1,250	104,437.50	0.15
1	GMEXICO	B	ALTA	1,250	104,437.50	0.15
<b>TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES</b>					1,116,188.13	1.62
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					68,723,891.00	100.00

**CATEGORÍA**  
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

**CALIFICACIÓN**  
N/A

**VaR Promedio**  
1.607%

**Limite de VaR**  
3.000%

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 255 datos.