VECTRF - VECTOR FONDO RF, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTO DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	260423	mxAAA	7,500,000	750,914,797.50	4.96
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					**750,914,797.50**	**4.96**
REPORTO						
LF	BONDESF	280127	mxAAA	29,040,574	2,890,079,514.65	19.08
LF	BONDESF	280323	mxAAA	21,925,554	2,178,692,650.47	14.38
LF	BONDESF	270225	mxAAA	18,583,629	1,849,719,062.44	12.21
IS	BPA182	301010	mxAAA	13,715,153	1,389,193,177.32	9.17
IS	BPA182	301010	mxAAA	11,818,693	1,211,628,985.66	8.00
LF	BONDESF	270930	mxAAA	5,024,731	500,462,901.18	3.30
LF	BONDESF	280323	mxAAA	5,034,075	500,462,896.59	3.30
LF	BONDESF	280127	mxAAA	5,049,058	500,462,871.83	3.30
LF	BONDESF	270318	mxAAA	5,033,526	500,462,869.98	3.30
IM	BPAG28	261105	mxAAA	5,034,675	500,462,867.89	3.30
LF	BONDESF	270422	mxAAA	5,023,709	500,462,862.09	3.30
IQ	BPAG91	270107	mxAAA	4,921,388	500,462,846.51	3.30
LF	BONDESF	270819	mxAAA	5,047,291	500,462,827.76	3.30
IQ	BPAG91	280106	mxAAA	4,921,134	500,462,817.66	3.30
TOTAL REPORTO					**14,023,479,152.03**	**92.59**
OTROS VALORES				3,714,376	**371,562,351.30**	**2.45**
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					**15,145,956,300.83**	**100.00**

CATEGORÍA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAA/1 S&P	0.000%	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.

Sr. Luis Eduardo Pavón Tinoco