

**VECTPRE - VECTOR FONDO PRE, 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 D						
LD	BONDES D	240801	mxAAA	4,500,000	453,424,464.00	2.16
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	241003	mxAAA	14,459,250	1,453,615,253.33	6.92
LF	BONDES F	260423	mxAAA	9,519,569	953,118,030.39	4.54
LF	BONDES F	260604	mxAAA	7,000,000	703,664,843.00	3.35
LF	BONDES F	250522	mxAAA	4,800,000	481,241,001.60	2.29
LF	BONDES F	260108	mxAAA	4,500,000	449,814,244.50	2.14
LF				14,263,139	1,429,778,414.11	6.81
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	241205	mxAAA	21,212,493	2,125,262,237.00	10.12
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	280511	mxAAA	5,182,290	523,221,022.22	2.49
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	70,000,000	588,708,400.00	2.80
BI	CETES	251224	mxAAA	50,000,000	426,924,800.00	2.03
BI				115,134,998	1,029,152,097.02	4.90
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					10,617,924,807.17	50.57
REPORTO						
IS	BPA182	260903	mxAAA	24,094,138	2,502,314,562.43	11.92
IS	BPA182	260903	mxAAA	24,094,138	2,502,314,562.43	11.92
IS	BPA182	251002	mxAAA	15,932,402	1,634,136,227.28	7.78
IS	BPA182	290927	mxAAA	12,205,954	1,251,151,025.10	5.96
IS	BPA182	240905	mxAAA	12,075,269	1,251,150,973.54	5.96
IS	BPA182	301010	mxAAA	5,148,706	527,835,136.11	2.51
IS	BPA182	260903	mxAAA	5,072,520	524,965,284.19	2.50
TOTAL REPORTO					10,193,867,771.08	48.55
OTROS VALORES				1,839,160	185,986,076.24	0.89
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					20,997,778,654.49	100.00

**CATEGORÍA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL**

CALIFICACIÓN
AAA/2 S&P

VaR Promedio
0.028%

Límite de VaR
0.070%

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.