

VECTMD - VECTOR FONDO MD, S.A. DE C.V. S.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 02 marzo, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IM	BPAG28	171123	mxAAA	250,000	25,043,016.75	1.86
IQ	BPAG91	170831	mxAAA	500,000	49,972,011.00	3.72
IS	BPA182	210909	mxAAA	350,000	36,172,096.10	2.69
LD	BONDESD	171019	HR AAA	300,000	30,100,176.90	2.24
LD	BONDESD	180628	HR AAA	500,000	50,118,615.50	3.73
LD	BONDESD	190627	HR AAA	2,000,000	200,100,638.00	14.90
LD	BONDESD	191003	Aaa.mx	1,500,000	149,656,164.00	11.14
PAPEL PRIVADO						
91	COLLAD	08-2	CCC(mex)	100,000	4,665,414.10	0.35
91	KIMBER	07	mxAAA	420,000	42,133,824.60	3.14
91	METROCB	02	D	252,450	565,488.00	0.04
93	CINMOBI	00812	MX-4	32,156	0.00	0.00
93	FORD	00617	F1+(mex)	400,000	39,898,384.40	2.97
93	VWLEASE	00817	mxA-1+	50,000	4,930,538.40	0.37
93	VWLEASE	00917	mxA-1+	50,000	4,994,366.70	0.37
93	VWLEASE	01117	mxA-1+	400,000	39,901,690.00	2.97
93	VWLEASE	01317	mxA-1+	410,000	40,843,755.56	3.04
97	BRHSCCB	06-4U	mxCC	14,765	3,113,481.67	0.23
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					722,209,661.68	53.78
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					722,209,661.68	53.78
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
BI	CETES	170525	mxA-1+	6	59.13	0.00
BI	CETES	170525	mxA-1+	7	68.98	0.00
LD	BONDESD	180419	HR AAA	1,915,147	191,553,473.06	14.26
LD	BONDESD	180419	HR AAA	2,499,930	250,043,612.27	18.62
LD	BONDESD	190808	HR AAA	586,135	58,490,129.74	4.36
LD	BONDESD	200730	HR AAA	1,209,503	120,545,858.09	8.98
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					620,633,201.27	46.22
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,342,842,862.95	100.00

CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/2 S&P

VaR Promedio
0.004%

Límite de VaR
0.030%

El Valor en Riesgo (VaR) es calculado con una metodología de simulación Monte Carlo con 1000 escenarios. Se utiliza para su cálculo un nivel de confianza de noventa y cinco por ciento y factores de riesgo de los últimos 255 días hábiles como período de muestra de un año. El horizonte de tiempo del VaR es un día.

Lic. Luis Alfredo de Urquijo Hernandez