

VECTPA - VECTOR FONDO DE PATRIMONIO, S.A. DE C.V. S.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 02 marzo, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TITULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTB	149,500	3,143,985.00	1.75
1	CEMEX	CPO	ALTB	971,246	16,802,555.80	9.34
1	GMEXICO	B	ALTB	236,591	14,990,405.76	8.33
1	MEXCHEM	*	ALTB	40,000	1,958,000.00	1.09
1	PE&OLES	*	ALTB	1,900	918,669.00	0.51
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTB	177,320	4,624,505.60	2.57
1	ASUR	B	ALTB	15,135	4,739,373.90	2.64
1	GAP	B	ALTB	42,096	7,355,434.08	4.09
1	OMA	B	ALTB	51,125	4,899,820.00	2.72
1	PINFRA	*	ALTB	20,024	3,735,276.96	2.08
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTB	30,646	1,726,902.10	0.96
1	LIVEPOL	C-1	ALTB	17,927	2,484,682.20	1.38
1	NEMAK	A	ALTB	50,434	1,012,714.72	0.56
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTB	49,682	5,660,767.08	3.15
1	BIMBO	A	ALTB	126,728	5,930,870.40	3.30
1	FEMSA	UBD	ALTB	135,251	22,237,969.42	12.36
1	GRUMA	B	ALTB	11,395	2,972,271.80	1.65
1	LACOMER	UBC	MEDB	135,704	1,870,001.12	1.04
1	WALMEX	*	ALTB	313,394	12,178,490.84	6.77
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	GFNORTE	O	ALTB	191,748	18,929,362.56	10.52
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTB	1,214,905	15,915,255.50	8.85
1	TLEVISA	CPO	ALTB	80,478	8,242,556.76	4.58
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					162,329,870.60	90.26
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					162,329,870.60	90.26
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
BI	CETES	170622	F1+(mex)	1,425,234	13,975,448.43	7.77
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					13,975,448.43	7.77
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	ASUR	B	ALTB	3,000	939,420.00	0.52
1	GRUMA	B	ALTB	10,000	2,608,400.00	1.45
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					3,547,820.00	1.97
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					179,853,139.03	100.00

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN
N/A

VaR Promedio
1.230%

Límite de VaR
3.000%

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 1 día.