

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
Clasificación: Mediano Plazo General

<u>T.VALOR.</u>	<u>EMISORA</u>	<u>SERIE</u>	<u>CALIF/BURS</u>	<u>VALOR TOTAL</u>	<u>%</u>
Bondes D				325,114,578.00	25.22%
LD	BONDES	201126	AAA(mex)	60,017,882.00	4.66%
LD	BONDES	180419	AAA(mex)	50,223,037.00	3.90%
LD	BONDES	181213	AAA(mex)	50,045,729.00	3.88%
LD	BONDES	200924	AAA(mex)	49,807,339.00	3.86%
LD	BONDES	191003	AAA(mex)	40,085,371.00	3.11%
LD	BONDES	210121	AAA(mex)	30,000,785.00	2.33%
LD	BONDES	200528	AAA(mex)	24,961,419.00	1.94%
LD	BONDES	200402	AAA(mex)	19,973,016.00	1.55%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				174,598,470.00	13.55%
95	FEFA	16-3	AAA(mex)	30,197,120.00	2.34%
95	PEMEX	12	Aa3.mx	25,034,075.00	1.94%
95	FNCOT	16-2	AAA(mex)	20,078,534.00	1.56%
95	CDVITOT	11-3U	AAA(mex)	19,045,886.00	1.48%
95	CEDEVIS	11-2U	AAA(mex)	17,140,624.00	1.33%
95	CEDEVIS	12U	AAA(mex)	11,674,062.00	0.91%
95	CEDEVIS	10-6U	AAA(mex)	7,012,892.00	0.54%
95	CDVITOT	13U	mxAAA	6,054,237.00	0.47%
95	TFOVIS	12-4U	AAA(mex)	5,930,554.00	0.46%
95	HITOTAL	10U	AAA(mex)	5,858,254.00	0.45%
95	CDVITOT	11U	AAA(mex)	5,403,585.00	0.42%
95	CEDEVIS	13U	AAA(mex)	5,031,434.00	0.39%
95	CFECB	09	Aa1.mx	4,622,803.00	0.36%
95	TFOVIS	10-4U	AAA(mex)	4,317,444.00	0.34%
95	CFEHC	09U	Aa1.mx	3,759,584.00	0.29%
95	CEDEVIS	05-3U	mxAAA	3,437,382.00	0.27%
Certificados Bursátiles Bancarios				83,212,081.00	6.46%
94	SCOTIAB	13	AAA(mex)	25,049,980.00	1.94%
94	BACOMER	15	AAA(mex)	20,106,344.00	1.56%
94	BSANT	16	AAA(mex)	20,014,469.00	1.55%
94	SCOTIAB	15	AAA(mex)	10,023,317.00	0.78%
94	COMPART	13	AA+(mex)	8,017,971.00	0.62%
Certificados Bursátiles Corporativos				86,163,084.00	6.69%
91	MONEX	14	A(mex)	15,089,818.00	1.17%
91	PCARFM	17	AAA(mex)	15,081,591.00	1.17%
91	NRF	17	mxAAA	15,038,721.00	1.17%
91	BNPPPF	16	AAA(mex)	15,033,283.00	1.17%
91	FUNO	13	AAA(mex)	10,097,318.00	0.78%
91	BLADEX	14	AAA(mex)	9,807,036.00	0.76%
91	GASN	15-2	mxAA+	6,015,317.00	0.47%
Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Fix)				110,230,511.00	8.55%
F	BSCTIA	17030	F1+(mex)	50,072,561.00	3.88%
F	BSCTIA	17020	F1+(mex)	30,087,093.00	2.33%
F	HSBCM	17004	F1+(mex)	30,070,857.00	2.33%
Cetes con Impuesto				145,403,773.00	11.28%
BI	CETES	180301	AAA(mex)	67,986,569.00	5.27%
BI	CETES	180426	AAA(mex)	48,039,995.00	3.73%
BI	CETES	180118	AAA(mex)	29,377,209.00	2.28%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				106,751,184.00	8.28%
I	BSCTIA	18091	F1+(mex)	50,372,424.00	3.91%
I	BANSAN	18321	F1+(mex)	28,233,240.00	2.19%
I	BANSAN	18343	F1+(mex)	28,145,520.00	2.18%
Reportos				202,492,658.00	15.71%
IQ	BPAG91	211223	AAA(mex)	202,174,439.00	15.68%
LD	BONDES	190328	AAA(mex)	318,219.00	0.03%
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				15,024,895.00	1.17%
JI	CABEI	2-15	mxAAA	15,024,895.00	1.17%
Udibonos				40,074,280.00	3.11%
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	40,074,280.00	3.11%

TOTAL CARTERA:

1,289,065,514.00

100.00%

ACTIVO NETO:

1,320,863,884.00

Cartera al:

2017-09-29

Límite Máximo de VaR:

0.38%

Var Promedio:

0.0340%

Parámetros:

La metodología utilizada para calcular el VaR es paramétrica al 95% de confianza con un año de historia y con un horizonte temporal de 1 día.

La presente información no es para algún perfil de inversión en específico por lo que el cliente que tenga acceso a ella, bajo su responsabilidad, deberá adoptar sus decisiones de inversión procurándose el asesoramiento específico y especializado que pueda ser necesario. Scotiabank Inverlat S.A. reconoce el derecho innegable que tiene el cliente de contratar a través de un tercero independiente los productos y/o servicios adicionales o ligados a los mencionados en esta publicación o aquellos que pudieran ofrecer cualesquiera de las Entidades de su Grupo Financiero o Económico. Producto ofrecido por Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple y/o Scotia Inverlat Casa de Bolsa, S.A. de C.V., ambas integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat.

Consulta comisiones, condiciones, guía de servicios de inversión y requisitos de contratación en www.scotiabank.com.mx