

SCOTIA2

AAAf/S4(mex)

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bondes D			332,447,532	25.12%
LD	BONDES	201126	AAA(mex)	59,930,317	4.53%
LD	BONDES	180419	AAA(mex)	50,158,855	3.79%
LD	BONDES	200924	AAA(mex)	50,023,280	3.78%
LD	BONDES	181213	AAA(mex)	49,978,915	3.78%
LD	BONDES	191003	AAA(mex)	40,024,893	3.02%
LD	BONDES	210121	AAA(mex)	29,955,480	2.26%
LD	BONDES	200528	AAA(mex)	24,925,290	1.88%
LD	BONDES	200402	AAA(mex)	19,943,150	1.51%
LD	BONDES	170824	AAA(mex)	7,507,354	0.57%
	Cedes			220,527,252	16.66%
F	BSCTIA	16058	F1+(mex)	50,231,514	3.80%
F	BSCTIA	17030	F1+(mex)	50,010,454	3.78%
F	BSCTIA	17003	F1+(mex)	30,163,602	2.28%
F	BSCTIA	17020	F1+(mex)	30,049,496	2.27%
F	BSCTIA	17011	F1+(mex)	30,037,186	2.27%
F	HSBCMX	17004	F1+(mex)	30,035,000	2.27%
	Cert. Bursatiles Bancarios			116,985,669	8.84%
94	BINBUR	14-6	mxAAA	30,038,216	2.27%
94	SCOTIAB	13	AAA(mex)	25,177,828	1.90%
94	BSANT	16	AAA(mex)	20,106,925	1.52%
94	BACOMER	15	AAA(mex)	20,082,764	1.52%
94	SCOTIAB	15	AAA(mex)	10,010,521	0.76%
94	COMPART	13	AA+(mex)	8,060,122	0.61%
94	COMPART	12	AA+(mex)	3,509,293	0.27%
	Certificado Bursatil			108,117,410	8.17%
91	VWLEASE	13-2	mxAAA	30,024,596	2.27%
91	DAIMLER	15-2	AAA(mex)	20,093,501	1.52%
91	BNPPPF	16	AAA(mex)	15,097,152	1.14%
91	MONEX	14	A(mex)	15,066,957	1.14%
91	FUNO	13	AAA(mex)	10,075,833	0.76%
91	BLADEX	14	AAA(mex)	9,796,677	0.74%
91	GASN	15-2	mxAA+	6,006,449	0.45%
91	BACHOCO	12	AAA(mex)	1,956,245	0.15%
	Cetes			202,440,167	15.30%
BI	CETES	180301	AAA(mex)	67,190,669	5.08%
BI	CETES	180426	AAA(mex)	47,469,840	3.59%
BI	CETES	171012	AAA(mex)	29,581,203	2.24%
BI	CETES	171221	AAA(mex)	29,178,270	2.21%
BI	CETES	180118	AAA(mex)	29,020,185	2.19%
	Eurobonos a Mediano Plazo MXP			19,832,807	1.50%
D8	JPM	5-07	A-	19,832,807	1.50%
	Pagare con R. L. V.			50,092,858	3.79%
I	BACMEXT	17334	F1+(mex)	30,067,783	2.27%
I	BACMEXT	17344	F1+(mex)	20,025,075	1.51%
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			15,091,011	1.14%
JI	CABEI	2-15	mxAAA	15,091,011	1.14%
	Valores paraestatales Rendim.			175,006,819	13.22%
95	FEFA	16-3	AAA(mex)	30,148,712	2.28%
95	PEMEX	12	Aa3.mx	25,150,326	1.90%
95	FNCOT	16-2	AAA(mex)	20,053,441	1.52%
95	CDVITOT	11-3U	AAA(mex)	18,672,938	1.41%
95	CEDEVIS	11-2U	AAA(mex)	16,798,503	1.27%
95	CEDEVIS	12U	AAA(mex)	12,543,570	0.95%
95	CEDEVIS	10-6U	AAA(mex)	6,881,840	0.52%
95	TFOVIS	12-4U	AAA(mex)	6,039,149	0.46%
95	CDVITOT	13U	mxAAA	5,935,969	0.45%
95	HITOTAL	10U	AAA(mex)	5,926,845	0.45%
95	CEDEVIS	13U	AAA(mex)	5,448,858	0.41%
95	CDVITOT	11U	AAA(mex)	5,298,360	0.40%
95	CFECB	09	Aa1.mx	4,563,356	0.35%
95	TFOVIS	10-4U	AAA(mex)	4,499,290	0.34%
95	CFEHCB	09U	Aa1.mx	3,663,422	0.28%
95	CEDEVIS	05-3U	mxAAA	3,382,241	0.26%
	Reportos			83,037,142	6.27%
IQ	BPAG91	211223	AAA(mex)	83,037,142	6.27%
	TOTAL CARTERA			1,323,578,668	100.00%
	ACTIVO NETO			1,322,182,670	
	VAR ESTABLECIDO \$			5,024,294	0.38%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			399,265	0.03%
	Cartera al:		31/Jul/2017		

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.

Clasificación: Mediano Plazo General.

Esta cartera se actualiza el quinto día hábil de cada mes

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.