

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
Clasificación: Corto Plazo Gubernamental

<u>T.VALOR.</u>	<u>EMISORA</u>	<u>SERIE</u>	<u>CALIF/BURS</u>	<u>VALOR TOTAL</u>	<u>%</u>
Bondes D				7,528,596,367.00	31.43%
LD	BONDES	171221	AAA(mex)	1,501,143,942.00	6.27%
LD	BONDES	171019	AAA(mex)	1,385,958,085.00	5.79%
LD	BONDES	180215	AAA(mex)	1,290,701,992.00	5.39%
LD	BONDES	180614	AAA(mex)	587,104,746.00	2.45%
LD	BONDES	181011	AAA(mex)	471,189,575.00	1.97%
LD	BONDES	180419	AAA(mex)	426,895,810.00	1.78%
LD	BONDES	190328	AAA(mex)	340,560,796.00	1.42%
LD	BONDES	190207	AAA(mex)	300,170,730.00	1.25%
LD	BONDES	180628	AAA(mex)	295,314,632.00	1.23%
LD	BONDES	180328	AAA(mex)	269,798,741.00	1.13%
LD	BONDES	171005	AAA(mex)	150,732,291.00	0.63%
LD	BONDES	181213	AAA(mex)	146,873,905.00	0.61%
LD	BONDES	200402	AAA(mex)	116,842,142.00	0.49%
LD	BONDES	180927	AAA(mex)	99,992,607.00	0.42%
LD	BONDES	191003	AAA(mex)	80,170,742.00	0.34%
LD	BONDES	180816	AAA(mex)	50,141,160.00	0.21%
LD	BONDES	201126	AAA(mex)	15,004,471.00	0.06%
Bonos de Protección al Ahorro (BPAG91)				892,638,806.00	3.73%
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	336,484,017.00	1.41%
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	304,070,376.00	1.27%
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	252,084,413.00	1.05%
Cetes con Impuesto				706,611,111.00	2.95%
BI	CETES	180104	AAA(mex)	412,397,664.00	1.72%
BI	CETES	171101	AAA(mex)	248,548,075.00	1.04%
BI	CETES	180301	AAA(mex)	38,849,468.00	0.16%
BI	CETES	171207	AAA(mex)	6,815,904.00	0.03%
Reportos				14,622,824,556.00	61.05%
IQ	BPAG91	201224	AAA(mex)	4,041,830,376.00	16.88%
IQ	BPAG91	191219	AAA(mex)	2,647,955,320.00	11.06%
IQ	BPAG91	211223	AAA(mex)	2,455,940,094.00	10.25%
LD	BONDES	200702	AAA(mex)	2,408,151,861.00	10.05%
LD	BONDES	220317	AAA(mex)	1,860,755,019.00	7.77%
LD	BONDES	200528	AAA(mex)	1,208,191,886.00	5.04%
Udibonos				200,376,188.00	0.84%
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	200,376,188.00	0.84%
TOTAL CARTERA:				23,951,047,028.00	100.00%
ACTIVO NETO:				25,702,876,179.00	

Cartera al: 2017-09-29

Límite Máximo de VaR: 0.04% Var Promedio: 0.0040%

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