

SCOTIMB

AAAf/S6(mex)

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			175,228,691	16.60%
M	BONOS	471107	AAA(mex)	99,668,175	9.44%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	32,333,243	3.06%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	21,107,381	2.00%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	11,366,102	1.08%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	10,753,789	1.02%
	Cetes			233,948,190	22.16%
BI	CETES	171221	AAA(mex)	97,260,900	9.21%
BI	CETES	180524	AAA(mex)	89,718,190	8.50%
BI	CETES	180621	AAA(mex)	46,969,100	4.45%
	Fondo de Inversion de Deuda			646,418,341	61.24%
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2	646,418,341	61.24%
	TOTAL CARTERA			1,055,595,222	100.00%
	ACTIVO NETO			1,068,977,402	
	VAR ESTABLECIDO \$			18,172,616	1.70%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,679,700	0.16%
	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: Discrecional Deuda.

TENENCIA INDIRECTA DE VALORES DE FONDOS DE INVERSION EN RENTA VARIABLE Y/O DEUDA

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Certific. Tesorería de la Fed.			60,463,492	9.35%
	VARIOS			45,390,984	7.02%
BI	CETES	171221		15,072,508	2.33%
	Bonos de Desarrollo Gob. Fed.			175,176,962	27.10%
	VARIOS			67,713,017	10.48%
LD	BONDESD	171221	AAA(mex)	36,219,627	5.60%
LD	BONDESD	171019	AAA(mex)	33,257,738	5.15%
LD	BONDESD	180215	AAA(mex)	23,898,671	3.70%
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	14,087,909	2.18%
	REPORTOS			410,777,885	63.55%
IQ	BPAG91	200423	AAA(mex)	199,519,388	30.87%
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	70,476,465	10.90%
IQ	BPAG91	211223	AAA(mex)	66,439,352	10.28%
LD	BONDESD	220113		36,191,500	5.60%
LD	BONDESD	200702	AAA(mex)	21,344,677	3.30%
LD	BONDESD	211118		16,806,503	2.60%
	TOTAL CARTERA			646,418,339	100.00%

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.