

## SCOT-TR

AAAf/S5(mex)

## FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>BPAS 182</b>			<b>85,387,995</b>	<b>4.44%</b>
IS	BPA182	190704	AAA(mex)	51,397,160	2.67%
IS	BPA182	200730	AAA(mex)	30,745,468	1.60%
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	3,245,367	0.17%
	<b>Bonos Gob. Fed. Tasa fija</b>			<b>91,794,383</b>	<b>4.78%</b>
M	BONOS	241205	AAA(mex)	38,315,396	1.99%
M	BONOS	220609	AAA(mex)	21,124,295	1.10%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	16,309,108	0.85%
M	BONOS	231207	AAA(mex)	10,559,197	0.55%
M	BONOS	210610	AAA(mex)	2,956,769	0.15%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	2,529,618	0.13%
	<b>Cedes</b>			<b>43,341,795</b>	<b>2.25%</b>
F	BANOBRA	U06002	AAA(mex)	23,179,265	1.21%
F	BANOBRA	U06008	AAA(mex)	20,162,529	1.05%
	<b>Cert. Bursatiles Bancarios</b>			<b>6,010,107</b>	<b>0.31%</b>
94	BACOMER	07U	AAA(mex)	6,010,107	0.31%
	<b>Certificado Bursatil</b>			<b>90,416,796</b>	<b>4.70%</b>
90	VRZCB	06U	AAA(mex)	47,577,325	2.48%
90	MICHCB	07U	mxA+	37,457,347	1.95%
90	CHIACB	07U	mxAA+	5,382,125	0.28%
	<b>Certificado Bursatil</b>			<b>38,424,477</b>	<b>2.00%</b>
91	FUNO	16U	AAA(mex)	20,703,760	1.08%
91	VIADI	06U	mxAA	17,720,716	0.92%
	<b>Eurobonos a Mediano Plazo MXP</b>			<b>37,661,655</b>	<b>1.96%</b>
D8	BAC	6-10	BBB+	37,661,655	1.96%
	<b>Notas Estruct. Int. a descuento</b>			<b>10,859,475</b>	<b>0.57%</b>
D2	CONM151	351215	BBB	10,859,475	0.57%
	<b>Tit. Deuda de Org. Multilat.</b>			<b>33,058,974</b>	<b>1.72%</b>
JI	CAF	11U	AAA(mex)	33,058,974	1.72%
	<b>Udibonos UDIS</b>			<b>433,916,604</b>	<b>22.57%</b>
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	170,583,954	8.87%
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	163,503,127	8.51%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	99,829,523	5.19%
	<b>Valores paraestatales Rendim.</b>			<b>860,002,308</b>	<b>44.73%</b>
95	TFOVIS	13-3U	AAA(mex)	81,638,568	4.25%
95	TFOVIS	13-2U	AAA(mex)	75,204,614	3.91%
95	CFECB	09-2U	Aa1.mx	72,532,831	3.77%
95	TFOVIS	14U	AAA(mex)	63,166,917	3.29%
95	TFOVIS	12-2U	AAA(mex)	52,986,000	2.76%
95	TFOVIS	10-3U	AAA(mex)	49,788,185	2.59%
95	HITOTAL	10U	AAA(mex)	46,965,821	2.44%
95	TFOVIS	10-4U	AAA(mex)	46,749,453	2.43%
95	CEDEVIS	07-3U	AAA(mex)	41,102,500	2.14%
95	CEDEVIS	10-4U	AAA(mex)	38,298,794	1.99%
95	CFECB	09U	Aa1.mx	33,876,460	1.76%
95	TFOVIS	14-2U	AAA(mex)	29,933,265	1.56%
95	PEMEX	10U	Aa3.mx	29,773,326	1.55%
95	TFOVIS	11U	AAA(mex)	29,374,339	1.53%
95	TFOVIS	12-3U	AAA(mex)	29,095,525	1.51%
95	PEMEX	14U	Aa3.mx	22,437,971	1.17%
95	PEMEX	11U	Aa3.mx	20,445,162	1.06%
95	TFOVIS	10-2U	AAA(mex)	17,551,878	0.91%
95	TFOVICB	15-2U	AAA(mex)	13,807,996	0.72%
95	CEDEVIS	07U	AAA(mex)	11,875,687	0.62%
95	CEDEVIS	10-6U	AAA(mex)	10,301,797	0.54%
95	CEDEVIS	06-4U	mxAAA	10,016,331	0.52%
95	CEDEVIS	08-2U	AAA(mex)	7,718,975	0.40%
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	7,143,709	0.37%
95	CFEHCB	09U	Aa1.mx	6,725,520	0.35%
95	CEDEVIS	09-4U	AAA(mex)	6,714,633	0.35%
95	CEDEVIS	06U	AAA(mex)	2,649,254	0.14%
95	CEDEVIS	06-3U	AAA(mex)	2,126,796	0.11%
	<b>Reportos</b>			<b>191,608,911</b>	<b>9.97%</b>
IS	BPA182	240307	AAA(mex)	191,608,911	9.97%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,922,483,479</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,920,063,815</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>32,641,085</b>	<b>1.70%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>5,836,219</b>	<b>0.30%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>15/Jun/2017</b>		

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: Largo plazo Tasa Real

Esta cartera se actualiza el último día hábil de cada semana

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](http://www.scotiabank.com.mx).