

SCOT-TR

AAA/S5

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

Clasificación: LARGO PLAZO TASA REAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos de Protección al Ahorro Pago Sem. Int. (BPA 182)			83,724,433	4.28%
IS	BPA182	190704	AAA(mex)	50,428,623	2.58%
IS	BPA182	200730	AAA(mex)	30,111,800	1.54%
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	3,184,011	0.16%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			179,741,882	9.19%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	57,250,884	2.93%
M	BONOS	220609	AAA(mex)	40,047,466	2.05%
M	BONOS	210610	AAA(mex)	39,219,119	2.01%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	23,982,373	1.23%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	19,242,041	0.98%
	Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Fix)			43,996,761	2.25%
F	BANOBRA	U06002	AAA(mex)	23,505,287	1.20%
F	BANOBRA	U06008	AAA(mex)	20,491,474	1.05%
	Certificados Bursátiles Bancarios			5,994,599	0.31%
94	BACOMER	07U	AAA(mex)	5,994,599	0.31%
	Certificados Bursátiles Municipales			88,346,220	4.52%
90	VRZCB	06U	AAA(mex)	45,950,284	2.35%
90	MICHCB	07U	mxA+	37,102,472	1.90%
90	CHACB	07U	mxAA+	5,293,464	0.27%
	Certificados Bursátiles Corporativos			36,671,369	1.88%
91	FUNO	16U	AAA(mex)	21,125,673	1.08%
91	VIADI	06U	mxAA	15,545,696	0.80%
	Títulos Emisoras Extranjeras SIC			38,272,431	1.96%
D8	BAC	6-10	BBB+	38,272,431	1.96%
	Eurobonos de Empresas Privadas (Tipo de Cambio Fix)			11,070,698	0.57%
D2	CONM151	351215	BBB	11,070,698	0.57%
	Títulos de Organismos Financieros Multilaterales			33,613,035	1.72%
J1	CAF	11U	AAA(mex)	33,613,035	1.72%
	Udibonos			488,674,587	24.99%
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	185,768,090	9.50%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	122,587,526	6.27%
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	107,085,037	5.48%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	63,149,650	3.23%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	10,084,284	0.52%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			778,492,493	39.81%
95	TFOVIS	13-3U	AAA(mex)	80,539,569	4.12%
95	TFOVIS	13-2U	AAA(mex)	74,262,762	3.80%
95	TFOVIS	14U	AAA(mex)	62,555,341	3.20%
95	CFECB	09-2U	Aa1.mx	53,411,087	2.73%
95	TFOVIS	12-2U	AAA(mex)	51,550,374	2.64%
95	HITOTAL	10U	AAA(mex)	46,322,023	2.37%
95	TFOVIS	10-4U	AAA(mex)	45,025,124	2.30%
95	CEDEVIS	07-3U	AAA(mex)	41,637,163	2.13%
95	CEDEVIS	10-4U	AAA(mex)	33,734,038	1.73%
95	PEMEX	10U	Aa3.mx	29,850,501	1.53%
95	TFOVIS	14-2U	AAA(mex)	29,754,904	1.52%
95	TFOVIS	12-3U	AAA(mex)	28,393,124	1.45%
95	TFOVIS	11U	AAA(mex)	27,969,839	1.43%
95	CFECB	09U	Aa1.mx	27,312,062	1.40%
95	PEMEX	14U	Aa3.mx	22,688,067	1.16%
95	PEMEX	11U	Aa3.mx	20,858,053	1.07%
95	TFOVIS	10-2U	AAA(mex)	15,479,610	0.79%
95	TFOVICB	15-2U	AAA(mex)	13,785,231	0.71%
95	CEDEVIS	07U	AAA(mex)	12,033,939	0.62%
95	CEDEVIS	10-6U	AAA(mex)	10,443,002	0.53%
95	CEDEVIS	06-4U	mxAAA	10,180,720	0.52%
95	FHIPOCB	17U	AAA(mex)	8,389,689	0.43%
95	CEDEVIS	08-2U	AAA(mex)	7,822,100	0.40%
95	CFEHC	09U	Aa1.mx	6,883,403	0.35%
95	CEDEVIS	09-4U	AAA(mex)	6,799,174	0.35%
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	5,931,823	0.30%
95	CEDEVIS	06U	AAA(mex)	2,711,402	0.14%
95	CEDEVIS	06-3U	AAA(mex)	2,168,330	0.11%
	Reportos			166,839,286	8.53%
IS	BPA182	240307	AAA(mex)	166,839,286	8.53%
	TOTAL CARTERA			1,955,437,794	100.00%
	ACTIVO NETO			1,956,310,143	
	Cartera al:			17/Ago/2017	

Límite Máximo de VaR: 1.70% Var Promedio: 0.2920%

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.

Límite autorizado por CNBV

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.