

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				7,381,838,579.00	27.76%
LD	BONDES	171221	AAA(mex)	1,504,413,181.00	5.66%
LD	BONDES	171019	AAA(mex)	1,388,958,420.00	5.22%
LD	BONDES	180215	AAA(mex)	1,293,517,495.00	4.86%
LD	BONDES	180614	AAA(mex)	585,183,021.00	2.20%
LD	BONDES	181011	AAA(mex)	469,716,557.00	1.77%
LD	BONDES	180419	AAA(mex)	425,498,444.00	1.60%
LD	BONDES	190328	AAA(mex)	339,494,454.00	1.28%
LD	BONDES	190207	AAA(mex)	300,822,225.00	1.13%
LD	BONDES	180628	AAA(mex)	295,961,897.00	1.11%
LD	BONDES	180328	AAA(mex)	268,913,269.00	1.01%
LD	BONDES	181213	AAA(mex)	147,200,832.00	0.55%
LD	BONDES	200402	AAA(mex)	117,100,840.00	0.44%
LD	BONDES	180927	AAA(mex)	100,216,699.00	0.38%
LD	BONDES	191003	AAA(mex)	79,909,113.00	0.30%
LD	BONDES	180816	AAA(mex)	49,976,658.00	0.19%
LD	BONDES	201126	AAA(mex)	14,955,474.00	0.06%
Bonos de Protección al Ahorro (BPAG91)				2,567,984,360.00	9.66%
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	1,655,135,467.00	6.22%
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	660,237,130.00	2.48%
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	252,611,763.00	0.95%
Cetes con Impuesto				904,953,183.00	3.40%
BI	CETES	180104	AAA(mex)	413,274,330.00	1.55%
BI	CETES	171101	AAA(mex)	249,075,850.00	0.94%
BI	CETES	180412	AAA(mex)	196,841,094.00	0.74%
BI	CETES	180301	AAA(mex)	38,931,272.00	0.15%
BI	CETES	171207	AAA(mex)	6,830,637.00	0.03%
Reportos				15,536,618,564.00	58.43%
IQ	BPAG91	210422	AAA(mex)	5,197,605,493.00	19.55%
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	4,804,375,028.00	18.07%
LD	BONDES	211118	AAA(mex)	2,495,610,700.00	9.39%
LD	BONDES	210915	AAA(mex)	1,992,689,970.00	7.49%
LD	BONDES	210121	AAA(mex)	790,191,225.00	2.97%
LD	BONDES	210722	AAA(mex)	256,146,148.00	0.96%
Udibonos				200,403,307.00	0.75%
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	200,403,307.00	0.75%
TOTAL CARTERA:				26,591,797,993.00	100.00%
ACTIVO NETO:				26,559,994,641.00	

Cartera al: 2017-10-12

Límite Máximo de VaR: 0.04% Var Promedio: 0.0030%

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