

SCOTILP				AAAf/S5(mex)	
FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
IS	BPAS 182			56,577,133	2.60%
	BPA182	190103	AAA(mex)	56,577,133	2.60%
	Bondes D			275,053,205	12.63%
LD	BONDESD	180927	AAA(mex)	85,010,924	3.90%
LD	BONDESD	190627	AAA(mex)	79,987,154	3.67%
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	70,078,902	3.22%
LD	BONDESD	181227	AAA(mex)	29,949,155	1.38%
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	10,027,071	0.46%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			78,587,754	3.61%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	26,233,078	1.21%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	21,852,073	1.00%
M	BONOS	220609	AAA(mex)	14,737,881	0.68%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	13,793,543	0.63%
M	BONOS	210610	AAA(mex)	1,971,179	0.09%
	Cedes			23,584,524	1.08%
F	BANOBRA	U06002	AAA(mex)	23,584,524	1.08%
	Cert. Bursátiles Bancarios			156,249,234	7.18%
94	BINBUR	14-7	mxAAA	47,948,223	2.20%
94	BACOMER	10	AAA(mex)	41,000,106	1.88%
94	SCOTIAB	15	AAA(mex)	36,110,442	1.66%
94	VWBANK	14	mxAAA	13,269,003	0.61%
94	COMPART	16-2	AA+(mex)	9,675,359	0.44%
94	SCOTIAB	13-2	AAA(mex)	8,246,102	0.38%
	Certificado Bursatil			44,419,823	2.04%
90	EDONL	06	AA+(mex)	44,419,823	2.04%
	Certificado Bursatil			529,674,825	24.33%
91	TELFIM	10	Aa3.mx	61,963,074	2.85%
91	MONEX	14	A(mex)	52,415,492	2.41%
91	VWLEASE	14-2	mxAAA	49,854,912	2.29%
91	RUBA	15	A(mex)	42,246,262	1.94%
91	FSHOP	15	AA(mex)	40,105,099	1.84%
91	TIPCB	17	AAA(mex)	33,286,945	1.53%
91	FACILSA	13-2	AAA(mex)	30,721,014	1.41%
91	SCRECB	16-2	AAA(mex)	28,255,100	1.30%
91	HOLCIM	12-3	AAA(mex)	27,032,676	1.24%
91	UNFINCB	15	mxAAA	26,088,811	1.20%
91	FUNO	13-2	AAA(mex)	19,733,829	0.91%
91	LIVEPOL	10U	AAA(mex)	18,546,231	0.85%
91	GASN	11	mxAA+	18,157,582	0.83%
91	FUNO	15	AAA(mex)	17,806,687	0.82%
91	HERDEZ	17	AA-(mex)	13,779,785	0.63%
91	FUNO	16U	AAA(mex)	12,422,142	0.57%
91	BIMBO	12	Aa2.mx	12,273,099	0.56%
91	ALSEA	15	A+(mex)	10,069,620	0.46%
91	FACILSA	14-2	AAA(mex)	10,015,219	0.46%
91	ACOSTCB	15	AA+(mex)	3,656,492	0.17%
91	CATFIN	14	mxAAA	1,244,757	0.06%
	Nota Estructurada sin Garantia			38,531,481	1.77%
JE	AMX	0619	AAA(mex)	38,531,481	1.77%
	Notas Estruct. Int. a descuento			10,859,475	0.50%
D2	CONM151	351215	BBB	10,859,475	0.50%
	Fondo de Inversion de Deuda			375,616,329	17.25%
51	SCOTLPG	C1E	AAA/6	375,616,329	17.25%
	Udibonos UDIS			188,323,038	8.65%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	120,692,158	5.54%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	40,483,264	1.86%
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	15,005,280	0.69%
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	10,434,648	0.48%
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	1,707,688	0.08%
	Valores paraestatales Rendim.			111,525,061	5.12%
95	HITOTAL	10U	AAA(mex)	22,059,907	1.01%
95	CFE	14-2	Aa1.mx	21,186,935	0.97%
95	PEMEX	10-2	Aa3.mx	16,947,518	0.78%
95	CEDEVIS	10-6U	AAA(mex)	9,205,625	0.42%
95	CDVITOT	13U	mxAAA	8,815,693	0.41%
95	TFOVIS	14U	AAA(mex)	7,906,125	0.36%
95	TFOVIS	13-2U	AAA(mex)	6,839,482	0.31%
95	CFEHCB	09U	Aa1.mx	5,433,521	0.25%
95	TFOVIS	10-4U	AAA(mex)	4,695,677	0.22%
95	CFECB	09	Aa1.mx	3,918,110	0.18%
95	CEDEVIS	11-2U	AAA(mex)	2,440,987	0.11%
95	TFOVIS	11U	AAA(mex)	2,075,483	0.10%
	Reportos			288,387,626	13.25%
IQ	BPAG91	210422	AAA(mex)	288,348,931	13.24%
LD	BONDESD	190411	AAA(mex)	38,695	0.00%
	TOTAL CARTERA			2,177,389,509	100.00%
	ACTIVO NETO			2,171,854,271	
	VAR ESTABLECIDO \$			15,202,980	0.70%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			4,404,654	0.20%
	Cartera al:		15/Jun/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 : Largo Plazo General.

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	%
	Fondos de Inversion de Deuda			119,605,386	31.84%
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2	119,605,386	31.84%
	BONOS del Gob. Fed.			240,871,313	64.13%
M	BONOS	210610	AAA(mex)	40,190,240	10.70%
M	BONOS	241205	AAA(mex)	39,771,979	10.59%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	39,614,104	10.55%
M	BONOS	220609	AAA(mex)	20,271,102	5.40%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	18,198,589	4.85%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	17,404,225	4.63%
M	BONOS	200611	AAA(mex)	14,348,602	3.82%
	VARIOS			13,398,263	3.57%
M	BONOS	231207	AAA(mex)	13,247,846	3.53%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	12,830,183	3.42%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	11,596,180	3.09%
	Bonos del Gob. Fed. en UDIS			15,139,629	4.03%
S	UDIBONO	401115		10,983,413	2.92%
	VARIOS			4,156,216	1.11%
	TOTAL CARTERA			375,616,328	100.00%

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.