

SCOTIMB

AAAf/S6(mex)

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			259,962,258	29.62%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	88,434,250	10.08%
M	BONOS	231207	AAA(mex)	84,473,572	9.62%
M	BONOS	220609	AAA(mex)	58,951,522	6.72%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	28,102,914	3.20%
	Cetes			88,965,477	10.14%
BI	CETES	180524	AAA(mex)	88,965,477	10.14%
	Fondo de Inversion de Deuda			528,787,928	60.25%
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2	528,787,928	60.25%
	TOTAL CARTERA			877,715,662	100.00%
	ACTIVO NETO			875,397,485	
	VAR ESTABLECIDO \$			14,881,757	1.70%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			2,568,229	0.26%
	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: 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.			7,210,318	1.36%
	VARIOS			7,210,318	1.36%
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			2,025,745	0.38%
	VARIOS			2,025,745	0.38%
	Bonos de Desarrollo Gob. Fed.			184,917,581	34.97%
	VARIOS			54,297,626	10.27%
LD	BONDESD	171221	AAA(mex)	29,998,630	5.67%
LD	BONDESD	171019	AAA(mex)	27,696,061	5.24%
LD	BONDESD	170622	AAA(mex)	21,851,725	4.13%
LD	BONDESD	180215	AAA(mex)	19,794,880	3.74%
LD	BONDESD	170706	AAA(mex)	19,610,552	3.71%
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	11,668,107	2.21%
	REPORTOS			334,634,287	63.28%
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	199,766,550	37.78%
LD	BONDESD	220113	AAA(mex)	74,785,111	14.14%
LD	BONDESD	200730	AAA(mex)	33,613,606	6.36%
LD	BONDESD	190411	AAA(mex)	26,469,020	5.01%
	TOTAL CARTERA			528,787,931	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.