

SCOTIAG

AAAf/S2(mex)

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

Categoría: Corto Plazo Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos de Protección al Ahorro Pago Sem. Int. (BPA 182)			40,381,347	0.16%
IS	BPA182	201022	AAA(mex)	40,381,347	0.16%
	Bondes D			3,612,336,441	13.85%
LD	BONDESD	200528	AAA(mex)	926,309,060	3.55%
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	900,112,999	3.45%
LD	BONDESD	190627	AAA(mex)	561,040,357	2.15%
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	512,545,543	1.97%
LD	BONDESD	191024	AAA(mex)	300,029,736	1.15%
LD	BONDESD	190801	AAA(mex)	280,054,866	1.07%
LD	BONDESD	200402	AAA(mex)	117,179,579	0.45%
LD	BONDESD	201126	AAA(mex)	15,064,302	0.06%
	Bonos de Protección al Ahorro (BPAG91)			1,183,701,600	4.54%
IQ	BPAG91	191219	AAA(mex)	559,655,965	2.15%
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	371,138,142	1.42%
IQ	BPAG91	200423	AAA(mex)	151,387,394	0.58%
IQ	BPAG91	201224	AAA(mex)	101,520,099	0.39%
	Reportos			21,237,292,607	81.45%
IM	BPAG28	210211	AAA(mex)	4,975,697,604	19.08%
LD	BONDESD	220908	AAA(mex)	4,577,611,525	17.56%
LD	BONDESD	220113	AAA(mex)	4,055,972,587	15.56%
LD	BONDESD	220512	AAA(mex)	2,203,245,552	8.45%
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	2,163,657,214	8.30%
IM	BPAG28	211111	AAA(mex)	1,735,386,417	6.66%
LD	BONDESD	220113	AAA(mex)	898,254,262	3.45%
IM	BPAG28	210812	AAA(mex)	627,467,445	2.41%
	TOTAL CARTERA			26,073,711,994	100.00%
	ACTIVO NETO			26,044,221,831	

Cartera al: 6/Jun/2019

Límite Máximo de VaR: 0.04%

Var Promedio: 0.0010%

SCOTIAG

AAAf/S2(mex)

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

Categoría: Corto Plazo Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
---------	---------	-------	--------------	-------------	---

Parametros: La metodología utilizada para calcular el VaR es parametrica al 95% de confianza con un año de historia y con un horizonte temporal de 1 día.

Límite autorizado por CNBV

“El Fondo actualmente no se encuentra en una estrategia temporal de inversión”