

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

SCOTIA DEUDA QUANT, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

Categoría: Discrecional

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				14,131,336.00	0.84 %
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2(mex)	14,131,336.00	0.84 %
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				1,662,553,031.00	99.16 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	168,805,327.00	10.07 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	157,669,608.00	9.40 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	149,003,809.00	8.89 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	145,256,656.00	8.66 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	142,018,013.00	8.47 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	133,354,253.00	7.95 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	123,191,909.00	7.35 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	116,950,440.00	6.98 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	115,675,618.00	6.90 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	97,485,980.00	5.81 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	92,186,482.00	5.50 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	88,304,562.00	5.27 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	73,594,041.00	4.39 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	59,056,333.00	3.52 %
TOTAL CARTERA:				1,676,684,367.00	100.00%
ACTIVO NETO				1,675,918,238.00	
Cartera al:			2024-11-29		

Límite Máximo de VaR: 1.70%

VaR Promedio: 0.6450%

Parámetros: La metodología utilizada para calcular el VaR es histórica con 500 observaciones al 95% de confianza y con un horizonte temporal de 1 día

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

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. 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

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

SCOTIA DEUDA QUANT, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

Categoría: Discrecional

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				16,204,862.00	0.96 %
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2(mex)	16,204,862.00	0.96 %
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				1,675,433,641.00	99.04 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	166,974,184.00	9.87 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	166,218,953.00	9.83 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	152,818,276.00	9.03 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	146,169,753.00	8.64 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	146,060,463.00	8.63 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	142,891,682.00	8.45 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	134,723,603.00	7.96 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	115,726,162.00	6.84 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	115,014,568.00	6.80 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	105,323,569.00	6.23 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	91,152,686.00	5.39 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	82,048,717.00	4.85 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	72,987,950.00	4.32 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	37,323,075.00	2.21 %
TOTAL CARTERA:				1,691,638,503.00	100.00%
ACTIVO NETO				1,687,825,479.00	
Cartera al:			2024-10-31		

Límite Máximo de VaR: 1.70%

VaR Promedio: 0.6130%

Parámetros: La metodología utilizada para calcular el VaR es histórica con 500 observaciones al 95% de confianza y con un horizonte temporal de 1 día

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

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. 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

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

SCOTIA DEUDA QUANT, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

Categoría: **Discrecional**

<u>T.VALOR</u>	<u>EMISORA</u>	<u>SERIE</u>	<u>CALIF/BURS</u>	<u>VALOR TOTAL</u>	<u>%</u>
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				4,354,995.00	0.27 %
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2(mex)	4,354,995.00	0.27 %
Udibonos				99,150,455.00	6.05 %
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	49,845,733.00	3.04 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	49,304,722.00	3.01 %
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				1,536,491,468.00	93.69 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	168,508,886.00	10.28 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	167,933,116.00	10.24 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	164,161,031.00	10.01 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	161,458,689.00	9.85 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	155,805,487.00	9.50 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	127,674,234.00	7.79 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	124,084,614.00	7.57 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	105,855,520.00	6.46 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	85,943,150.00	5.24 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	78,381,386.00	4.78 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	76,111,657.00	4.64 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	52,283,969.00	3.19 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	38,833,488.00	2.37 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	29,456,241.00	1.80 %
TOTAL CARTERA:				1,639,996,918.00	100.00%
ACTIVO NETO				1,646,337,969.00	
Cartera al:			2024-09-30		

Límite Máximo de VaR: 1.70%

VaR Promedio: 0.5800%

Parámetros: La metodología utilizada para calcular el VaR es histórica con 500 observaciones al 95% de confianza y con un horizonte temporal de 1 día

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

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. 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

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

SCOTIA DEUDA QUANT, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

Categoría: Discrecional

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				5,756,299.00	0.38 %
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2(mex)	5,756,299.00	0.38 %
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				1,513,646,595.00	99.62 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	180,117,157.00	11.85 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	170,226,043.00	11.20 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	160,691,919.00	10.58 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	156,835,987.00	10.32 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	151,815,914.00	9.99 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	120,570,302.00	7.94 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	119,865,326.00	7.89 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	107,934,977.00	7.10 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	83,085,977.00	5.47 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	73,624,059.00	4.85 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	58,273,186.00	3.84 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	50,368,556.00	3.32 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	42,520,729.00	2.80 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	37,716,463.00	2.48 %
TOTAL CARTERA:				1,519,402,894.00	100.00%
ACTIVO NETO				1,521,984,441.00	
Cartera al:			2024-08-30		

Límite Máximo de VaR: 1.70%

VaR Promedio: 0.5750%

Parámetros: La metodología utilizada para calcular el VaR es histórica con 500 observaciones al 95% de confianza y con un horizonte temporal de 1 día

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

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. 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

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

SCOTIA DEUDA QUANT, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

Categoría: Discrecional

<u>T.VALOR</u>	<u>EMISORA</u>	<u>SERIE</u>	<u>CALIF/BURS</u>	<u>VALOR TOTAL</u>	<u>%</u>
Udibonos				20,189,688.00	1.16 %
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	20,189,688.00	1.16 %
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				116,841,246.00	6.70 %
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2(mex)	116,841,246.00	6.70 %
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				1,606,205,307.00	92.14 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	177,487,096.00	10.18 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	172,533,228.00	9.90 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	167,873,244.00	9.63 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	158,636,110.00	9.10 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	136,111,827.00	7.81 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	135,385,092.00	7.77 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	108,563,672.00	6.23 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	107,171,995.00	6.15 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	106,255,172.00	6.10 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	83,727,546.00	4.80 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	74,969,429.00	4.30 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	72,716,297.00	4.17 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	67,634,130.00	3.88 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	37,140,469.00	2.13 %
TOTAL CARTERA:				1,743,236,241.00	100.00%
ACTIVO NETO				1,740,612,833.00	
Cartera al:			2024-07-31		

Límite Máximo de VaR: 1.70%

VaR Promedio: 0.5640%

Parámetros: La metodología utilizada para calcular el VaR es histórica con 500 observaciones al 95% de confianza y con un horizonte temporal de 1 día

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

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. 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

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

SCOTIA DEUDA QUANT, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

Categoría: **Discrecional**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda				226,851,826.00	13.74 %
51	SCOTIAG	C1E	AAA/2(mex)	226,851,826.00	13.74 %
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				1,423,685,165.00	86.26 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	152,072,654.00	9.21 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	147,258,936.00	8.92 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	147,167,337.00	8.92 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	137,252,262.00	8.32 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	116,927,881.00	7.08 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	114,351,401.00	6.93 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	114,240,073.00	6.92 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	87,193,588.00	5.28 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	86,000,678.00	5.21 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	82,526,605.00	5.00 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	75,311,258.00	4.56 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	71,721,289.00	4.35 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	65,206,745.00	3.95 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	26,454,458.00	1.60 %
TOTAL CARTERA:				1,650,536,991.00	100.00%
ACTIVO NETO				1,718,816,482.00	

Cartera al: **2024-06-28**

Límite Máximo de VaR: **1.70%**

VaR Promedio: **0.5030%**

Parámetros: **La metodología utilizada para calcular el VaR es histórica con 500 observaciones al 95% de confianza y con un horizonte temporal de 1 día**

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

51	SCOTIAG	La tenencia indirecta en Fondos de Inversión o mecanismos de inversión colectiva que en lo individual representan más del 10% de la composición de la Cartera, se podrán consultar en la siguiente ruta: http://www.scotiabank.com.mx/es-mx/personas/inversiones/productos/fondos-de-inversion/personas-fisicas/fondo-de-deuda/scotiag.aspx
-----------	----------------	---

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. 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