

Scotia Fondos.

Scotia Multiactivos Volatilidad Controlada

SCOTMA2

Scotia Multiactivos Volatilidad Controlada 2, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable

Cartera al 25 de enero de 2024

T. Valor	Emisora	Serie	Descripción	Vencimiento	Calif / Burs	Valor Total	%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)						32,315,900.00	7.75 %
IISP	VTV	*	Vanguard Value Index Fund	N/A	Alta	16,980,114.00	4.07 %
IISP	QQQ	*	Invesco Qqq Trust ETF	N/A	Alta	15,335,786.00	3.68 %
Acciones de Fondos de Inversión de Instrumentos de Deuda						163,622,954.00	39.24 %
51	SCOTUDI	CIE	Scotia Deuda Gubernamental Tasa Real	N/A	AAA/6(mex)	51,429,065.00	12.33 %
51	SCOTIA1	CIE	Scotia Deuda Corto Plazo Plus	N/A	AAA/2(mex)	48,969,039.00	11.74 %
51	SCOTIMB	CIE	Scotia Deuda Largo Plazo Volatilidad Controlada	N/A	AAA/6(mex)	30,050,702.00	7.21 %
51	SCOTLPG	CIE	Scotia Deuda Gubernamental Largo Plazo	N/A	AAA/6(mex)	25,175,692.00	6.04 %
51	SCOTDGH	CIE	Scotia Deuda Corporativa Global Peso Hedged	N/A	Af/S7(mex)	7,998,456.00	1.92 %
Acciones de Fondos de Inversión						221,097,227.00	53.02 %
52	SCOTGLO	CIE	Scotia Acciones Globales Volatilidad Controlada	N/A	N/A	131,410,889.00	31.51 %
52	SCOTDL+	CIE	Scotia Especializado Deuda Dólares Plus	N/A	N/A	22,864,906.00	5.48 %
52	SCOTUSA	CIE	Scotia Acciones Estados Unidos	N/A	N/A	22,793,422.00	5.47 %
52	SCOT-LB	CIE	Acciones de Fondos de Inversión	N/A	N/A	20,091,415.00	4.82 %
52	SCOTDIH	CIE	Scotia Especializado Deuda Intl. Peso HEDGED	N/A	N/A	10,063,489.00	2.41 %
52	SCOT-FR	CIE	Scotia Fibras	N/A	N/A	7,367,040.00	1.77 %
52	SCOT-RV	CIE	Scotia Acciones Mexico	N/A	N/A	6,506,066.00	1.56 %
Total Cartera						417,036,081.00	
Activo Neto						420,402,643.00	

Categoría: Discrecional

Límite Máximo de VaR: 2.50%

Calificación del fondo:

Var Promedio: 0.5210%

51	SCOTUDI	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/scotudi.aspx
51	SCOTIA1	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/scotia1.aspx
52	SCOTGLO	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/fondos-de-renta-variable/scot-glo.aspx

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

Límite autorizado por CNBV.

“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 adotar 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 acceder a los servicios adicionales o ligados a los mencionados en esta publicación o aquellos que pudieran ofrecer cualesquiera de las Entidades de 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. TM Marca de The Bank of Nova Scotia, utilizada bajo licencia.

Scotia Global Asset Management, S.A.