



SK-GUB SKANDIA DG, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	241107	mxAAA	1,500,000	150,465,853.50	5.91
LF	BONDES F	250327	mxAAA	1,000,000	100,284,465.00	3.94
LF	BONDES F	250403	mxAAA	1,000,000	100,061,677.00	3.93
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	1,000,000	100,539,721.00	3.95
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250306	mxAAA	14,722,412	136,670,138.12	5.37
BI	CETES	250109	mxAAA	13,000,000	122,683,886.00	4.82
BI	CETES	250206	mxAAA	10,991,065	102,869,092.31	4.04
BI	CETES	241114	mxAAA	10,361,698	99,427,869.84	3.90
BI	CETES	240801	mxAAA	10,000,000	99,067,830.00	3.89
BI	CETES	240822	mxAAA	10,000,000	98,421,290.00	3.86
BI	CETES	240905	mxAAA	10,000,000	98,001,410.00	3.85
BI	CETES	241017	mxAAA	10,093,884	97,673,599.75	3.83
BI	CETES	240919	mxAAA	10,000,000	97,582,130.00	3.83
BI	CETES	241003	mxAAA	10,000,000	97,170,970.00	3.81
BI	CETES	250403	mxAAA	9,500,000	87,449,599.50	3.43
BI	CETES	250430	mxAAA	9,500,000	86,755,985.50	3.41
BI	CETES	240718	mxAAA	8,000,000	79,586,856.00	3.12
BI	CETES	241031	mxAAA	7,982,534	76,925,971.90	3.02
BI	CETES	241128	mxAAA	7,954,138	76,004,166.88	2.98
BI	CETES	240711	mxAAA	7,000,000	69,785,891.00	2.74
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				10,000,000	99,063,980.00	3.89
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,076,492,383.30	81.51
REPORTO						
LF	BONDES F	270617	mxAAA	3,927,539	390,705,163.19	15.34
TOTAL REPORTO					390,705,163.19	15.34
OTROS VALORES				800,000	80,219,168.20	3.15
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,547,416,714.69	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
HR AAA/ICP

VaR Promedio
0.008%

Límite de VaR
0.150%

El VaR se calcula y expresa con un horizonte temporal para el que se estima la minusvalía de un día.
A su vez, el VaR se expresa a una cola de distribución de probabilidad. Por ejemplo, un VaR diario de 0.15% sobre una inversión de \$100,000 con una probabilidad del 95% significa que, con esa probabilidad, la peor minusvalía sobre esa inversión en un día sería de \$150.00.
Cabe destacar que la definición del Valor en Riesgo es válida únicamente en condiciones normales de mercado.

Julio César Méndez Ávalos