



SK-GUB SKANDIA DG, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 11 JULIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	241107	mxAAA	1,500,000	150,977,469.00	6.07
LF	BONDES F	250327	mxAAA	1,000,000	100,625,390.00	4.05
LF	BONDES F	250403	mxAAA	1,000,000	100,401,859.00	4.04
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA</b>						
M	BONOS	241205	mxAAA	500,000	50,251,688.50	2.02
<b>BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL</b>						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	1,000,000	100,025,223.00	4.02
IM	BPAG28	250508	mxAAA	500,000	50,090,296.50	2.01
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>						
BI	CETES	250306	mxAAA	14,722,412	137,072,221.92	5.51
BI	CETES	250109	mxAAA	13,000,000	123,052,228.00	4.95
BI	CETES	250206	mxAAA	10,991,065	103,178,347.91	4.15
BI	CETES	241114	mxAAA	10,361,698	99,755,973.01	4.01
BI	CETES	240801	mxAAA	10,000,000	99,392,600.00	4.00
BI	CETES	240822	mxAAA	10,000,000	98,759,790.00	3.97
BI	CETES	240905	mxAAA	10,000,000	98,335,710.00	3.95
BI	CETES	241017	mxAAA	10,093,884	97,997,906.15	3.94
BI	CETES	240919	mxAAA	10,000,000	97,917,080.00	3.94
BI	CETES	241003	mxAAA	10,000,000	97,502,500.00	3.92
BI	CETES	250403	mxAAA	9,500,000	87,740,451.50	3.53
BI	CETES	250430	mxAAA	9,500,000	87,049,706.50	3.50
BI	CETES	240718	mxAAA	8,000,000	79,853,472.00	3.21
BI	CETES	241031	mxAAA	7,982,534	77,179,058.14	3.10
BI	CETES	241128	mxAAA	7,954,138	76,244,389.80	3.07
BI	CETES	240725	mxAAA	5,000,000	49,802,165.00	2.00
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				10,472,137	98,918,146.15	3.98
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>2,162,123,672.08</b>	<b>86.93</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDES F	290419	mxAAA	2,961,097	295,051,451.63	11.86
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>295,051,451.63</b>	<b>11.86</b>
<b>OTROS VALORES</b>				300,000	29,970,917.10	1.21
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>2,487,146,040.81</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
IDCPGUB

**CALIFICACIÓN**  
HR AAA/1CP

**VaR Promedio**  
0.007%

**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.