



**SK-DCP SKANDIA DEUDA CORTO PLAZO, 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	250403	mxAAA	4,000,000	401,607,436.00	2.67
LF	BONDES F	250327	mxAAA	3,930,000	395,457,782.70	2.63
LF	BONDES F	241107	mxAAA	3,500,000	352,280,761.00	2.34
<b>BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL</b>						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	7,000,000	701,264,151.00	4.66
IM	BPAG28	240808	mxAAA	6,340,316	634,191,521.79	4.22
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTEF				5,988,797	600,790,499.34	3.99
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				10,623,144	1,020,037,093.38	6.78
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				9,251,062	829,431,575.15	5.51
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>						
BI	CETES	240725	mxAAA	58,000,000	577,705,114.00	3.84
BI	CETES	240822	mxAAA	58,013,359	572,938,715.20	3.81
BI	CETES	240919	mxAAA	45,997,108	450,390,250.38	2.99
BI	CETES	241017	mxAAA	44,145,958	428,597,301.97	2.85
BI	CETES	250306	mxAAA	45,722,412	425,696,047.92	2.83
BI	CETES	250626	mxAAA	45,000,000	405,641,745.71	2.70
BI	CETES	250403	mxAAA	40,554,123	374,551,269.71	2.49
BI	CETES	240718	mxAAA	35,000,000	349,358,940.00	2.32
BI	CETES	241128	mxAAA	34,513,200	330,826,278.60	2.20
BI	CETES	240815	mxAAA	33,000,000	326,604,564.00	2.17
BI	CETES	241226	mxAAA	33,700,094	320,314,810.26	2.13
BI	CETES	241114	mxAAA	33,260,120	320,207,714.31	2.13
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				329,047,234	3,117,685,579.95	20.73
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>12,935,579,151.66</b>	<b>85.99</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDES F	280127	mxAAA	3,998,728	400,122,248.87	2.66
LF	BONDES F	270930	mxAAA	4,043,145	400,122,246.80	2.66
LF	BONDES F	290419	mxAAA	3,037,331	302,647,606.82	2.01
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>1,102,892,102.49</b>	<b>7.33</b>
<b>OTROS VALORES</b>				19,522,115	<b>1,004,256,268.49</b>	<b>6.68</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>15,042,727,522.64</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA  
IDCP**

**CALIFICACIÓN**  
HR AAA/1CP

**VaR Promedio**  
0.010%

**Límite de VaR**  
0.220%

El riesgo se mide por el concepto de VaR. El VaR se define como la pérdida máxima esperada a un cierto nivel de confianza y en condiciones normales de mercado. Por ejemplo, si se tiene una inversión de 100 pesos y un VaR diario de 0.22% al 95% de confianza, significa que nuestra inversión puede perder como máximo 0.22% en un día. Ahora bien, Al hacer el cálculo a un nivel de confianza del 95%, podríamos esperar que de cada 100 días existan cinco en el que la inversión genere una pérdida mayor al 0.22%.

La metodología utilizada para el cálculo del Valor en Riesgo (VaR) es a través de un método paramétrico en la cual la volatilidad del fondo será estimada mediante la suavización exponencial de Risk Metrics.

A grandes rasgos, lo que se hace para medir el riesgo es tomar la cartera del fondo del día a valuar y se toman los precios históricos de los instrumentos en los que está invirtiendo el Fondo de Inversión. Con esto se calcula una distribución de probabilidad empírica y se calculan los cuantiles muestrales tales que nos den la máxima pérdida esperada al nivel de confianza del 95% asumiendo que la distribución de los rendimientos es normal.