



**SK-DCP SKANDIA DEUDA CORTO PLAZO, 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	250403	mxAAA	4,000,000	400,246,708.00	2.59
LF	BONDES F	250327	mxAAA	3,930,000	394,117,947.45	2.55
LF	BONDES F	241107	mxAAA	3,500,000	351,086,991.50	2.27
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	6,340,316	637,453,601.69	4.13
IM	BPAG28	250508	mxAAA	4,500,000	453,140,896.50	2.93
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTEF				5,988,797	600,982,070.28	3.89
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				10,589,395	1,019,359,463.40	6.60
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				9,124,062	814,431,342.79	5.27
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	240725	mxAAA	58,000,000	575,807,760.00	3.73
BI	CETES	240822	mxAAA	58,013,359	570,974,963.00	3.70
BI	CETES	240919	mxAAA	45,997,108	448,849,577.25	2.91
BI	CETES	241017	mxAAA	44,145,958	427,178,936.48	2.77
BI	CETES	250306	mxAAA	45,722,412	424,447,323.12	2.75
BI	CETES	250626	mxAAA	45,000,000	404,381,385.68	2.62
BI	CETES	250403	mxAAA	40,554,123	373,309,664.68	2.42
BI	CETES	240718	mxAAA	35,000,000	348,192,495.00	2.25
BI	CETES	241128	mxAAA	34,513,200	329,783,945.45	2.14
BI	CETES	240815	mxAAA	33,000,000	325,501,308.00	2.11
BI	CETES	241114	mxAAA	33,260,120	319,154,532.61	2.07
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				357,452,519	3,397,711,976.64	22.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					12,616,112,888.84	81.69
REPORTO						
BI	CETES	250206	mxAAA	64,129,318	600,553,991.48	3.89
LF	BONDES F	270617	mxAAA	5,055,721	502,934,865.40	3.26
LF	BONDES F	271014	mxAAA	5,051,014	500,460,737.08	3.24
TOTAL REPORTO					1,603,949,593.96	10.39
OTROS VALORES				12,187,866	1,223,297,143.91	7.92
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					15,443,359,626.71	100.00

**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.