

skandia :

Publicaciones trimestrales. 1º Trimestre 2013.

Administración de Riesgos Financieros

Estadísticas en Materia de Riesgos Financieros al 01/04/2013

Concepto	SK-DCP	SK-DEST	SK-RVMX	SK-RVST
Valor en Riesgo	0.04172%	0.08408%	1.61109%	1.26462%
VaR sin Exposición a Moneda Extranjera	0.04172%	0.08408%	1.61109%	1.30249%
X-Loss con cobertura	0.05003%	0.20123%	2.52884%	4.97891%
Duración Modificada (Años)	0.21	0.20	0.00	0.00
Duración (Años)	0.21	0.20	0.00	0.00
Maduración Normativa (Días)	74.00	71.15	0.00	0.00
Valor_Portafolio	\$1,454.07	\$1,801.62	\$670.54	\$208.64

El valor total de la inversión en los 4 fondos asciende a **\$4,134,870,232.43**

Las posiciones se encuentran por debajo de los límites diarios establecidos para cada uno de los fondos al cierre del trimestre:

Límite de VaR:

SK-DCP: 0.22%

SK-DEST: 1.70%

SK-RVMX: 5.86%

SK-RVST: 5.29%

Los cálculos han sido creados bajo un método paramétrico considerando un EWMA (suavizamiento exponencial) con un factor de decaimiento del 0.94 y un mínimo de 252 observaciones.

<i>Tipo Valor</i>	<i>SK-DCP A</i>	<i>SK-DESTA</i>	<i>SK-RVMXA</i>	<i>SK-RVSTA</i>	<i>Grand Total</i>
<i>1</i>	0.00%	0.00%	7.72%	6.18%	1.56%
<i>1B</i>	0.00%	0.00%	87.90%	9.73%	14.75%
<i>1C</i>	0.00%	6.60%	0.00%	0.00%	2.88%
<i>1ISP</i>	0.00%	0.00%	0.00%	82.38%	4.16%
<i>51</i>	88.34%	83.77%	1.11%	1.67%	67.83%
<i>CHD</i>	0.00%	0.00%	0.01%	0.03%	0.01%
<i>M</i>	0.00%	1.24%	0.00%	0.00%	0.54%
<i>S</i>	0.00%	1.79%	0.00%	0.00%	0.78%
<i>LD</i>	11.66%	4.42%	0.00%	0.00%	6.02%
<i>CF</i>	0.00%	0.00%	3.25%	0.00%	0.53%
<i>91</i>	0.00%	2.18%	0.00%	0.00%	0.95%
<i>Grand Total</i>	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%

Tipo Valor:

<i>1</i>	<i>Acciones Industriales Comerciales y de Servicios</i>
<i>1B</i>	<i>Acciones referidas a los Titulos Referenciados a Acciones</i>
<i>1C</i>	<i>TRACK de Deuda Corporativa</i>
<i>1ISP</i>	<i>"Titulos Referenciados a acciones ""Trac's Extranjeras"" (Tipo de cambio Spot)"</i>
<i>51</i>	<i>Acciones de Sociedades de Inversion de Instrumentos de Deuda</i>
<i>CHD</i>	<i>Chequeras</i>
<i>M</i>	<i>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija a 20 a±os</i>
<i>S</i>	<i>Udibonos</i>
<i>LD</i>	<i>Bondes D</i>
<i>CF</i>	<i>Fibras Certificados Inmobiliarios (CI)</i>
<i>91</i>	<i>Certificados Bursatiles Corporativos</i>

Segmentación por Emisora y por Categoría.

<i>Row Labels</i>	<i>SK-DCP A</i>	<i>SK-DESTA</i>	<i>SK-RVMXA</i>	<i>SK-RVSTA</i>	<i>Grand Total</i>
<i>America Movil</i>	0.00%	2.18%	0.00%	0.00%	0.95%
<i>Chequera</i>	0.00%	0.00%	0.01%	0.03%	0.01%
<i>Gubernamental</i>	11.66%	7.44%	0.00%	0.00%	7.34%
<i>iShares</i>	0.00%	6.60%	87.90%	82.44%	21.29%
<i>Principal</i>	60.18%	16.90%	1.11%	1.67%	28.79%
<i>Sura</i>	23.42%	59.50%	0.00%	0.00%	34.16%
<i>Vector</i>	4.74%	7.37%	0.00%	0.00%	4.88%
<i>State Street Global Advisors</i>	0.00%	0.00%	0.00%	9.67%	0.49%
<i>Femsa</i>	0.00%	0.00%	2.80%	4.00%	0.66%
<i>Banorte</i>	0.00%	0.00%	1.47%	0.00%	0.24%
<i>Wall Mart</i>	0.00%	0.00%	1.10%	0.00%	0.18%
<i>Fibra Uno</i>	0.00%	0.00%	1.43%	0.00%	0.23%
<i>FIBRA Macquarie México</i>	0.00%	0.00%	1.83%	0.00%	0.30%
<i>Tiendas Liverpool</i>	0.00%	0.00%	2.35%	2.19%	0.49%
Grand Total	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%

<i>Row Labels</i>	<i>SK-DCP A</i>	<i>SK-DESTA</i>	<i>SK-RVMXA</i>	<i>SK-RVSTA</i>	<i>Grand Total</i>
<i>Acciones de Sociedades de Inversion de Instrumentos d</i>	88.13%	83.38%	1.27%	1.69%	68.75%
<i>Acciones Industriales Comerciales y de Servicios</i>	0.00%	0.00%	8.56%	6.23%	1.58%
<i>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija a 20 a±os</i>	0.00%	1.29%	0.00%	0.00%	0.57%
<i>Chequera en pesos (MXN)</i>	0.00%	0.00%	0.01%	0.03%	0.01%
<i>Consumer Defensive</i>	0.00%	0.00%	19.84%	0.00%	2.93%
<i>Emerging Markets Bond</i>	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
<i>Large-Cap Mexico</i>	0.00%	0.00%	51.63%	5.67%	7.91%
<i>Mexbol</i>	0.00%	0.00%	1.50%	3.27%	0.39%
<i>Mid-Cap Value</i>	0.00%	0.00%	13.35%	0.68%	2.00%
<i>Udibonos</i>	0.00%	1.81%	0.00%	0.00%	0.80%
<i>World Stock</i>	0.00%	0.00%	0.00%	72.53%	3.75%
<i>Bondes D</i>	11.87%	4.51%	0.00%	0.00%	6.24%
<i>Consumer Cyclical</i>	0.00%	0.00%	0.00%	9.89%	0.51%
<i>Fibras Certificados Inmobiliarios (CI)</i>	0.00%	0.00%	3.82%	0.00%	0.56%
<i>Certificados Bursatiles Corporativos</i>	0.00%	2.27%	0.00%	0.00%	1.00%
<i>Mexican Government Debt</i>	0.00%	6.74%	0.00%	0.00%	2.98%
Grand Total	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%

<i>Row Labels</i>	<i>SK-DCP A</i>	<i>SK-DESTA</i>	<i>SK-RVMXA</i>	<i>SK-RVSTA</i>	<i>Grand Total</i>
<i>Mercado de Capitales Extranjero</i>	0.00%	0.00%	0.00%	82.38%	4.16%
<i>Mercado de Capitales Nacional</i>	0.00%	6.60%	98.88%	15.92%	19.71%
<i>Mercado de Deuda Nacional</i>	100.00%	93.40%	1.12%	1.70%	76.13%
<i>Grand Total</i>	<i>100.00%</i>	<i>100.00%</i>	<i>100.00%</i>	<i>100.00%</i>	<i>100.00%</i>