



**SK-DEST SKANDIA DEUDA ESTRATEGICA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 07 AGOSTO, 2025**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	280224	mxAAA	2,000,000	200,097,200.00	3.52
LF	BONDES F	270520	mxAAA	1,500,000	150,359,437.50	2.65
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				1,500,000	150,039,247.50	2.64
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	360221	mxAAA	6,000,000	574,549,914.00	10.12
M	BONOS	341123	mxAAA	2,400,000	224,321,589.60	3.95
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INT				2,000,000	200,700,167.40	3.54
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				3,070,000	318,188,369.14	5.60
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				8,612,421	909,447,790.26	16.02
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCI				1,750,000	188,608,293.75	3.32
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260416	mxAAA	35,000,000	331,684,115.00	5.84
BI	CETES	270121	mxAAA	30,000,000	267,493,740.00	4.71
BI	CETES	270708	mxAAA	30,000,000	258,279,660.00	4.55
BI	CETES	260625	mxAAA	27,600,000	257,623,837.20	4.54
BI	CETES	251016	mxAAA	25,000,000	246,336,300.00	4.34
BI	CETES	250821	mxAAA	20,000,000	199,435,940.00	3.51
BI	CETES	251224	mxAAA	20,000,000	194,173,180.00	3.42
BI	CETES	270513	mxAAA	20,000,000	174,152,320.00	3.07
BI	CETES	260806	mxAAA	15,000,000	138,792,690.00	2.44
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUEST				40,429,000	378,551,403.37	6.67
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,362,835,194.72	94.46
REPORTO						
IQ	BPAG91	300110	mxAAA	1,565,568	156,656,871.32	2.76
TOTAL REPORTO					156,656,871.32	2.76
OTROS VALORES				952,664	158,007,669.01	2.78
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,677,499,735.05	100.00

	CATEGORÍA	
	IDMP	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
AAA/3 HR	0.194%	1.039%

El Valor en Riesgo se estima a partir de una metodología histórica (VaR Histórico) con 250 datos. Para ello se re-evalúa el portafolio en cada uno de los escenarios, tomando como base un horizonte de un día, al 95% de nivel de confianza. Por ejemplo, un VaR diario de 1.039% 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 \$1,039.00. Cabe destacar que la definición del Valor en Riesgo es válida únicamente en condiciones normales de mercado.