



SK-DEST SKANDIA DEUDA ESTRATEGICA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 JUNIO, 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	199,734,574.00	3.62
LF	BONDES F	270520	mxAAA	1,500,000	150,029,419.50	2.72
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	341123	mxAAA	7,400,000	681,289,991.00	12.35
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INT				4,555,250	424,815,738.85	7.70
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				3,070,000	316,177,454.45	5.73
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				8,612,421	897,800,965.91	16.27
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES				1,750,000	183,920,883.75	3.33
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260416	mxAAA	35,000,000	328,259,645.00	5.95
BI	CETES	270121	mxAAA	30,000,000	264,583,170.00	4.80
BI	CETES	251016	mxAAA	25,000,000	244,150,875.00	4.43
BI	CETES	250821	mxAAA	20,000,000	197,736,660.00	3.58
BI	CETES	251224	mxAAA	20,000,000	192,381,700.00	3.49
BI	CETES	260305	mxAAA	20,000,000	189,373,900.00	3.43
BI	CETES	270513	mxAAA	20,000,000	172,072,840.00	3.12
BI	CETES	260806	mxAAA	15,000,000	137,265,210.00	2.49
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				36,003,964	338,309,916.35	6.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,917,902,943.81	89.14
REPORTO						
BI	CETES	260416	mxAAA	29,037,656	272,344,316.24	4.94
TOTAL REPORTO					272,344,316.24	4.94
OTROS VALORES				2,652,664	327,017,714.76	5.93
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,517,264,974.81	100.00

CATEGORÍA
IDMP

CALIFICACIÓN
AAA/3 HR

VaR Promedio
0.230%

Límite de VaR
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.

Julio César Méndez Ávalos