



SK-GUB SKANDIA DG, 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						
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				680,008	68,264,690.57	2.35
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260723	mxAAA	25,000,000	232,048,200.00	8.00
BI	CETES	250821	mxAAA	19,767,456	197,117,058.44	6.80
BI	CETES	251211	mxAAA	20,000,000	194,734,600.00	6.72
BI	CETES	251224	mxAAA	20,000,000	194,173,180.00	6.70
BI	CETES	260528	mxAAA	20,000,000	187,802,620.00	6.48
BI	CETES	260401	mxAAA	15,000,000	142,587,615.00	4.92
BI	CETES	260430	mxAAA	15,000,000	141,708,825.00	4.89
BI	CETES	260108	mxAAA	13,000,000	125,808,098.00	4.34
BI	CETES	251016	mxAAA	12,500,000	123,168,150.00	4.25
BI	CETES	270318	mxAAA	12,000,000	105,718,416.00	3.65
BI	CETES	250904	mxAAA	10,000,000	99,429,270.00	3.43
BI	CETES	251002	mxAAA	10,000,000	98,833,560.00	3.41
BI	CETES	260205	mxAAA	10,000,000	96,204,120.00	3.32
BI	CETES	260305	mxAAA	10,000,000	95,620,640.00	3.30
BI	CETES	260416	mxAAA	10,000,000	94,766,890.00	3.27
BI	CETES	251030	mxAAA	8,000,000	78,597,432.00	2.71
BI	CETES	260625	mxAAA	8,000,000	74,673,576.00	2.58
BI	CETES	270121	mxAAA	7,500,000	66,873,435.00	2.31
BI	CETES	250918	mxAAA	6,000,000	59,479,098.00	2.05
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,477,609,474.01	85.45
REPORTO						
IS	BPA182	320324	mxAAA	4,159,908	421,777,580.45	14.55
TOTAL REPORTO					421,777,580.45	14.55
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,899,387,054.46	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
HR AAA/1CP

VaR Promedio
0.013%

Límite de VaR
0.150%

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 0.150% 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 \$150.00. Cabe destacar que la definición del Valor en Riesgo es válida únicamente en condiciones normales de mercado.

Julio César Méndez Ávalos