



SK-DCP SKANDIA DEUDA CORTO PLAZO, 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	260604	mxAAA	7,147,123	715,576,880.32	3.97
LF	BONDES F	250828	mxAAA	4,000,000	400,695,756.00	2.22
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				7,019,992	703,314,269.83	3.90
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				6,670,522	626,986,870.57	3.48
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,357,620	1,175,869,582.88	6.52
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	251030	mxAAA	73,325,697	720,401,435.48	3.99
BI	CETES	251224	mxAAA	70,000,000	679,606,130.00	3.77
BI	CETES	260205	mxAAA	70,000,000	673,428,840.00	3.73
BI	CETES	260723	mxAAA	72,000,000	668,298,816.00	3.71
BI	CETES	251211	mxAAA	68,000,000	662,097,640.00	3.67
BI	CETES	251113	mxAAA	60,000,000	587,681,760.00	3.26
BI	CETES	250821	mxAAA	55,000,000	548,448,835.00	3.04
BI	CETES	251016	mxAAA	55,000,000	541,939,860.00	3.01
BI	CETES	250918	mxAAA	50,000,000	495,659,150.00	2.75
BI	CETES	251127	mxAAA	50,000,000	488,315,800.00	2.71
BI	CETES	260108	mxAAA	50,000,000	483,877,300.00	2.68
BI	CETES	260305	mxAAA	50,000,000	478,103,200.00	2.65
BI	CETES	260401	mxAAA	50,000,000	475,292,050.00	2.64
BI	CETES	260528	mxAAA	50,000,000	469,506,550.00	2.60
BI	CETES	260625	mxAAA	50,000,000	466,709,850.00	2.59
BI	CETES	270318	mxAAA	50,000,000	440,493,400.00	2.44
BI	CETES	251002	mxAAA	40,000,000	395,334,240.00	2.19
BI	CETES	260430	mxAAA	40,000,000	377,890,200.00	2.10
BI	CETES	270121	mxAAA	41,500,000	370,033,007.00	2.05
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUEST				185,000,000	1,787,655,185.00	9.91
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					15,433,216,608.08	85.58
REPORTO						
M	BONOS	280302	mxAAA	3,929,332	400,088,656.31	2.22
TOTAL REPORTO					400,088,656.31	2.22
OTROS VALORES				29,508,807	2,199,555,334.01	12.20
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					18,032,860,598.40	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
HR AAA/1CP

VaR Promedio
0.011%

Límite de VaR
0.220%

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 0.22% 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 \$220.00. Cabe destacar que la definición del Valor en Riesgo es válida únicamente en condiciones normales de mercado.

Julio César Méndez Ávalos