



SK-DCP SKANDIA DEUDA CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 31 JULIO, 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	714,457,204.89	3.96
LF	BONDES F	250828	mxAAA	4,000,000	400,069,168.00	2.22
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				7,019,992	702,207,240.44	3.90
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTEI				4,488,797	450,139,594.06	2.50
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				6,670,522	625,940,959.39	3.47
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,357,620	1,224,804,044.08	6.80
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	251030	mxAAA	73,325,697	718,967,331.49	3.99
BI	CETES	251224	mxAAA	70,000,000	678,201,440.00	3.76
BI	CETES	251211	mxAAA	68,000,000	660,668,484.00	3.67
BI	CETES	251113	mxAAA	60,000,000	586,498,800.00	3.25
BI	CETES	250807	mxAAA	55,000,000	549,265,145.00	3.05
BI	CETES	250821	mxAAA	55,000,000	547,591,495.00	3.04
BI	CETES	251016	mxAAA	55,000,000	540,837,385.00	3.00
BI	CETES	250918	mxAAA	50,000,000	494,699,650.00	2.74
BI	CETES	251127	mxAAA	50,000,000	487,239,800.00	2.70
BI	CETES	260108	mxAAA	50,000,000	482,792,250.00	2.68
BI	CETES	260205	mxAAA	50,000,000	479,948,800.00	2.66
BI	CETES	260305	mxAAA	50,000,000	477,098,850.00	2.65
BI	CETES	260401	mxAAA	50,000,000	474,235,050.00	2.63
BI	CETES	260528	mxAAA	50,000,000	468,392,600.00	2.60
BI	CETES	260625	mxAAA	50,000,000	465,399,250.00	2.58
BI	CETES	270318	mxAAA	50,000,000	438,678,650.00	2.43
BI	CETES	260723	mxAAA	47,000,000	434,945,661.00	2.41
BI	CETES	251002	mxAAA	40,000,000	394,538,480.00	2.19
BI	CETES	260430	mxAAA	40,000,000	376,961,680.00	2.09
BI	CETES	270121	mxAAA	41,500,000	368,868,932.00	2.05
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUEST				155,000,000	1,490,040,965.00	8.27
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					15,733,488,909.35	87.30
REPORTO						
LF	BONDES F	270923	mxAAA	5,016,869	500,111,938.64	2.78
M	BONOS	290531	mxAAA	5,047,452	500,111,863.19	2.78
TOTAL REPORTO					1,000,223,801.83	5.55
OTROS VALORES				12,879,875	1,288,521,390.73	7.15
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					18,022,234,101.91	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
HR AAA/1CP

VaR Promedio
0.016%

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.