

INDICADORES DE RIESGO SIEFORE INVERCAP BÁSICA INICIAL

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

| TIPO DE RIESGO | VaR DIARIO % |
|---------------------|--------------|
| VaR Paramétrico (1) | 0.833004% |
| VaR Histórico (2) | 0.903588% |

ACTIVO TOTAL

\$4,636,026,974.61

VaR PARAMÉTRICO VS VaR HISTÓRICO

- (1) VaR Paramétrico con un horizonte de un día con 1000 escenarios y un nivel de confianza de 97.4%. El porcentaje es con respecto al Activo Total que se utiliza para medir el VaR
- (2) VaR Histórico con un horizonte de un día con 1000 escenarios y el Nivel de Confianza/Número de Escenarios que publica CONSAR en su página de internet http://www.consar.gob.mx/gobmx/Aplicativo/Escenarios_Var/escenarios_var.aspx y que se determina de acuerdo a la metodología del Anexo L de las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las Sociedades de Inversión Especializadas de Fondos para el Retiro". El porcentaje es con respecto al Activo Total que se utiliza para medir el VaR



RIESGO DE CRÉDITO

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR CALIDAD CREDITICIA

| NIVEL DE CALIFICACIÓN | MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO | % CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL |
|-----------------------|------------------------------------|--|
| C | 0.00 | 0.0000% |
| BB | 6,019,106.91 | 0.1298% |
| BBB | 107,981,773.66 | 2.3292% |
| A | 110,947,793.31 | 2.3932% |
| AA | 100,603,642.72 | 2.1700% |
| AAA | 5,220,362.76 | 0.1126% |
| TOTAL | 330,772,679.36 | 7.1348% |

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

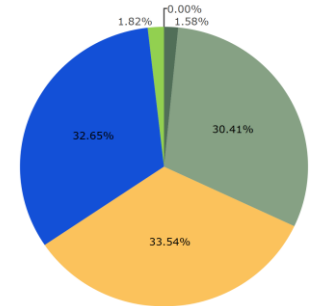


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR PLAZO

| PLAZO AL VENCIMIENTO | MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO | % CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL |
|----------------------|------------------------------------|--|
| 0-360 días | 19,851,038.08 | 0.4282% |
| 361-720 días | 9,299,606.78 | 0.2006% |
| 721-1092 días | 23,905,562.14 | 0.5156% |
| 1093-1820 días | 79,923,988.03 | 1.7240% |
| 1821-3600 días | 133,349,990.99 | 2.8784% |
| Mas de 3600 días | 64,442,493.34 | 1.3900% |
| Indefinido | 0.00 | 0.0000% |
| TOTAL | 330,772,679.36 | 7.1348% |

Gráfico 2: Exposición por plazo

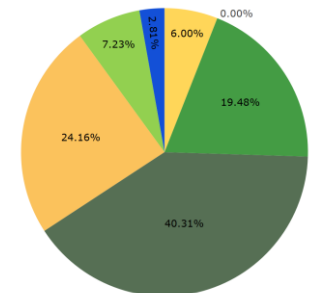


Gráfico 2: Exposición por plazo

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

| SECTOR | MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO | % CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL |
|----------------------|------------------------------------|--|
| Financiero | 23,243,376.55 | 0.5014% |
| Consumo Frecuente | 17,362,045.67 | 0.3751% |
| Servicios Públicos | 0.00 | 0.0000% |
| Telecom | 75,557,831.05 | 1.6298% |
| Peaje Carretero | 23,756,765.58 | 0.5124% |
| Transporte | 21,228,363.17 | 0.4579% |
| Energía | 102,408,310.42 | 2.2090% |
| Consumo Discrecional | 8,948,874.21 | 0.1930% |
| Real Estate | 48,603,129.92 | 1.0484% |
| Hipotecas | 0.00 | 0.0000% |
| Gobierno | 9,633,982.79 | 0.2078% |
| TOTAL | 330,772,679.36 | 7.1348% |

Gráfico 3: Exposición por sector

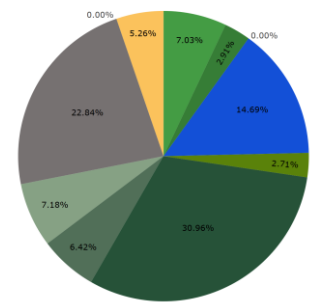


Gráfico 3: Exposición por sector

INDICADORES DE RIESGO

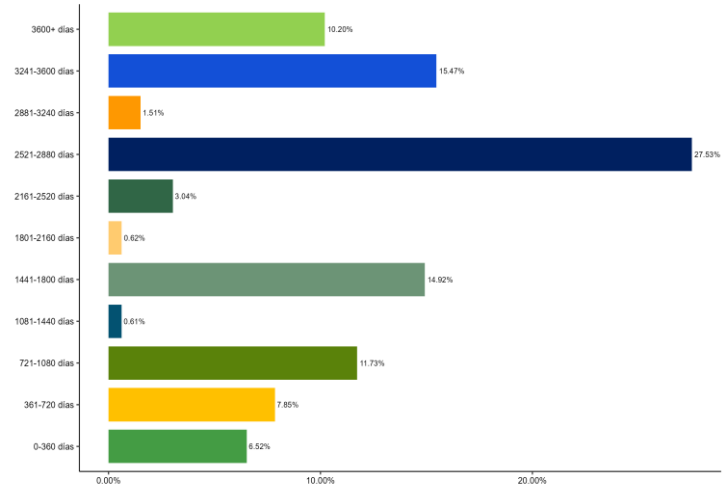
SIEFORE INVERCAP BÁSICA INICIAL

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

| PLAZO AL VENCIMIENTO | TOTAL (IMPORTE CON INTERESES) |
|----------------------|-------------------------------|
| 0-360 días | 53,880,070.14 |
| 361-720 días | 64,828,846.45 |
| 721-1080 días | 96,880,078.51 |
| 1081-1440 días | 5,076,564.94 |
| 1441-1800 días | 123,228,634.00 |
| 1801-2160 días | 5,127,373.98 |
| 2161-2520 días | 25,085,299.44 |
| 2521-2880 días | 227,397,937.20 |
| 2881-3240 días | 12,485,007.05 |
| 3241-3600 días | 127,780,347.10 |
| 3600+ días | 84,271,405.75 |
| TOTAL | 826,041,564.56 |

DESGLOSE POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS



| DERIVADOS | MERCADO |
|---------------------------|---------------|
| FUTUROS DE DIVISAS | LISTADO |
| FUTUROS DE TASAS | LISTADO |
| FORWARD DE DIVISAS | OTC |
| FORWARD DE RENTA VARIABLE | OTC |
| SWAP DE TASAS | LISTADO / OTC |

RENDIMIENTO NETO

RENDIMIENTO NETO

RENDIMIENTO NETO (AL CIERRE DE MAYO DEL 2024)*

NOMINAL **5.38%**

*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-inicial>

ESTRUCTURA DE COMISIONES

COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL

2024 **0.57%**