

INDICADORES DE RIESGO SIEFORE INVERCAP BÁSICA 85 - 89

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.844544%
VaR Histórico (2)	0.925662%

- (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

ACTIVO TOTAL

\$36,804,487,650.09

VaR PARAMÉTRICO VS VaR HISTÓRICO



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	3,270,079.88	0.0089%
BB	100,882,938.20	0.2741%
BBB	1,340,346,190.29	3.6418%
A	1,040,409,869.77	2.8269%
AA	1,906,093,236.80	5.1790%
AAA	55,184,933.19	0.1499%
TOTAL	4,446,187,248.13	12.0806%

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

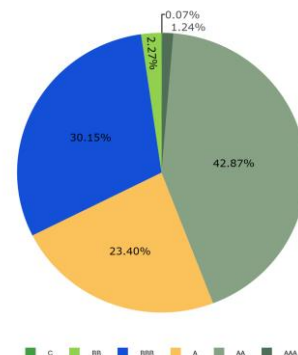


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

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	83,886,254.57	0.2279%
361-720 días	45,413,685.66	0.1234%
721-1092 días	911,372,201.96	2.4763%
1093-1820 días	946,762,133.30	2.5724%
1821-3600 días	1,203,292,137.68	3.2694%
Mas de 3600 días	1,254,818,320.97	3.4094%
Indefinido	642,513.79	0.0017%
TOTAL	4,446,187,248.13	12.0806%

Gráfico 2: Exposición por plazo

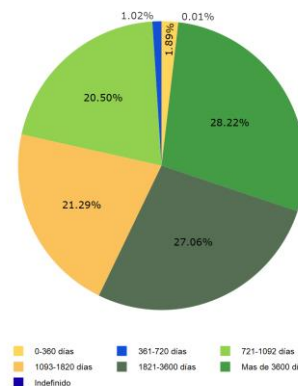


Gráfico 2: Exposición por plazo

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	78,526,719.44	0.2134%
Consumo Frecuente	555,683,884.33	1.5098%
Servicios Públicos	28,701,321.38	0.0789%
Telecom	599,189,470.70	1.6280%
Peaje Carretero	762,515,237.83	2.0718%
Transporte	506,651,976.66	1.3766%
Energía	1,059,770,510.11	2.8795%
Consumo Discrecional	46,596,461.51	0.1266%
Real Estate	535,906,583.40	1.4561%
Hipotecas	3,270,079.88	0.0089%
Gobierno	269,375,002.89	0.7319%
TOTAL	4,446,187,248.13	12.0806%

Gráfico 3: Exposición por sector

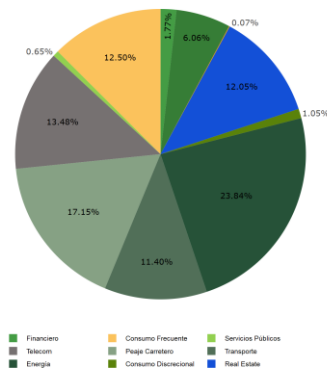


Gráfico 3: Exposición por sector

INDICADORES DE RIESGO

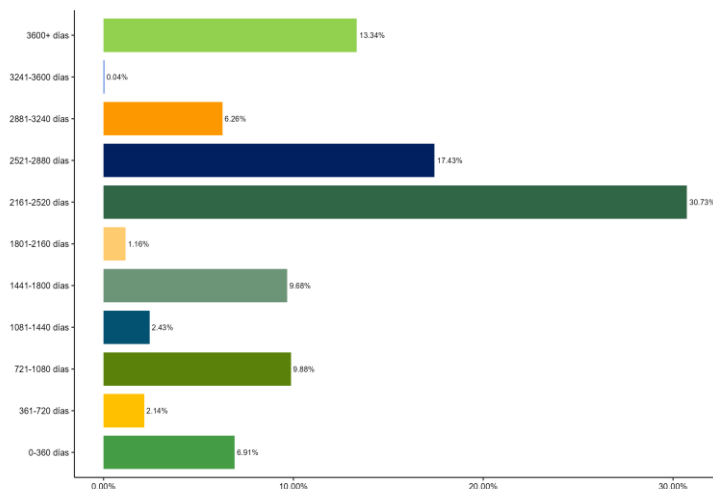
SIEFORE INVERCAP BÁSICA 85 - 89

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	438,974,571.90
361-720 días	136,182,524.10
721-1080 días	627,408,640.00
1081-1440 días	154,064,258.00
1441-1800 días	614,825,560.60
1801-2160 días	73,835,947.86
2161-2520 días	1,952,337,473.00
2521-2880 días	1,107,268,471.00
2881-3240 días	397,928,913.60
3241-3600 días	2,627,566.09
3600+ días	847,394,260.50
TOTAL	6,352,848,186.65

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 AGOSTO DEL 2024)*

NOMINAL **5.23%**

*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-85-89>

ESTRUCTURA DE COMISIONES

COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL

2024 **0.57%**