

INDICADORES DE RIESGO SIEFORE INVERCAP BÁSICA 95 - 99

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.818394%
VaR Histórico (2)	0.859389%

ACTIVO TOTAL

\$4,836,406,169.85

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

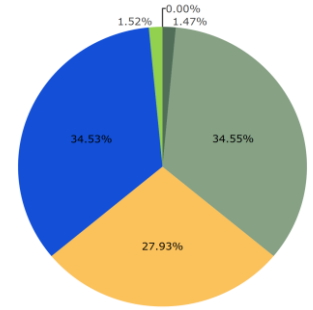


RIESGO DE CRÉDITO

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	4,851,854.07	0.1003%
BBB	110,255,061.10	2.2797%
A	89,180,292.07	1.8439%
AA	110,340,888.02	2.2815%
AAA	4,703,300.98	0.0972%
TOTAL	319,331,396.24	6.6027%

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia



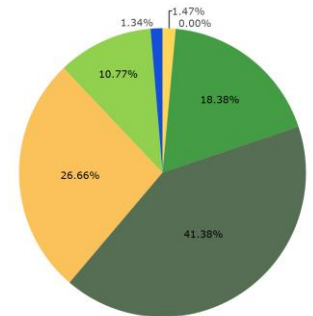
■ C ■ BB ■ BBB ■ A ■ AA ■ AAA

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	4,703,300.98	0.0972%
361-720 días	4,273,076.68	0.0884%
721-1092 días	34,396,613.63	0.7112%
1093-1820 días	85,149,030.87	1.7609%
1821-3600 días	132,123,661.22	2.7319%
Mas de 3600 días	58,685,682.86	1.2134%
Indefinido	0.00	0.0000%
TOTAL	319,331,396.24	6.6027%

Gráfico 2: Exposición por plazo



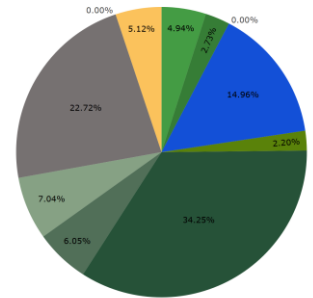
■ 0-360 días ■ 361-720 días ■ 721-1092 días
■ 1093-1820 días ■ 1821-3600 días ■ Mas de 3600 días
■ Indefinido

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	15,784,944.73	0.3264%
Consumo Frecuente	16,353,172.25	0.3381%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	72,554,908.65	1.5002%
Peaje Carretero	22,470,155.14	0.4646%
Transporte	19,317,783.49	0.3994%
Energía	109,357,178.85	2.2611%
Consumo Discrecional	7,012,180.94	0.1450%
Real Estate	47,757,803.51	0.9875%
Hipotecas	0.00	0.0000%
Gobierno	8,723,269.68	0.1804%
TOTAL	319,331,396.24	6.6027%

Gráfico 3: Exposición por sector



■ Financiero ■ Consumo Frecuente ■ Servicios Públicos
■ Telecom ■ Consumo Frecuente ■ Transporte
■ Energía ■ Consumo Discrecional ■ Real Estate
■ Hipotecas ■ Gobierno

Gráfico 3: Exposición por sector

INDICADORES DE RIESGO

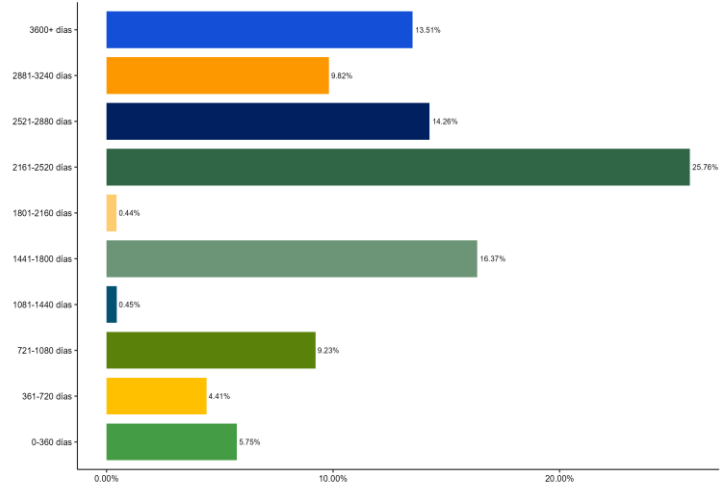
SIEFORE INVERCAP BÁSICA 95 - 99

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	62,294,305.96
361-720 días	47,744,169.54
721-1080 días	99,905,111.84
1081-1440 días	4,844,088.50
1441-1800 días	177,172,241.00
1801-2160 días	4,786,537.11
2161-2520 días	278,804,281.00
2521-2880 días	154,382,654.60
2881-3240 días	106,303,184.30
3600+ días	146,271,480.80
TOTAL	1,082,508,054.65

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 **5.28%**

*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-95-99>

ESTRUCTURA DE COMISIONES

COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL

2024 **0.57%**