

# INDICADORES DE RIESGO SIEFORE INVERCAP BÁSICA 60 - 64

## RIESGO DE MERCADO

### VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.496779%
VaR Histórico (2)	0.534565%

- (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](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**  
**\$14,505,149,516.00**

### VaR PARAMÉTRICO VS VaR HISTÓRICO

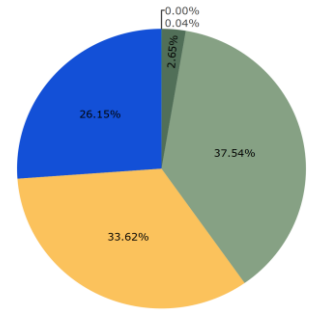


## RIESGO DE CRÉDITO

### 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	1,354,701.62	0.0093%
BB	0.00	0.0000%
BBB	882,120,882.21	6.0814%
A	1,134,324,042.68	7.8201%
AA	1,266,657,502.40	8.7325%
AAA	89,484,565.16	0.6170%
<b>TOTAL</b>	<b>3,373,951,694.07</b>	<b>23.2604%</b>

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia



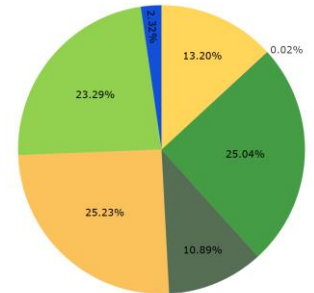
■ C ■ BB ■ BBB ■ A ■ AA ■ AAA

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	445,476,166.27	3.0712%
361-720 días	78,219,879.58	0.5393%
721-1092 días	785,801,652.96	5.4174%
1093-1820 días	851,407,607.21	5.8697%
1821-3600 días	387,547,972.74	2.5339%
Mas de 3600 días	844,783,589.05	5.8240%
Indefinido	714,846.26	0.0049%
<b>TOTAL</b>	<b>3,373,951,694.07</b>	<b>23.2604%</b>

Gráfico 2: Exposición por plazo



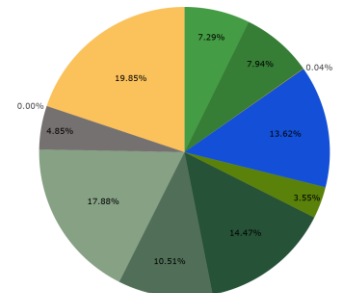
■ 0-360 días ■ 361-720 días ■ 721-1092 días  
■ 1093-1820 días ■ 1821-3600 días ■ Mas de 3600 días  
■ Indefinido

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	245,810,421.28	1.6946%
Consumo Frecuente	669,866,453.90	4.6181%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	163,722,436.58	1.1287%
Peaje Carretero	603,383,473.58	4.1598%
Transporte	354,642,794.41	2.4449%
Energía	488,096,144.52	3.3650%
Consumo Discrecional	119,748,185.27	0.8256%
Real Estate	459,419,853.52	3.1673%
Hipotecas	1,354,701.62	0.0093%
Gobierno	287,907,229.39	1.8470%
<b>TOTAL</b>	<b>3,373,951,694.07</b>	<b>23.2604%</b>

Gráfico 3: Exposición por sector



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

Gráfico 3: Exposición por sector

# INDICADORES DE RIESGO

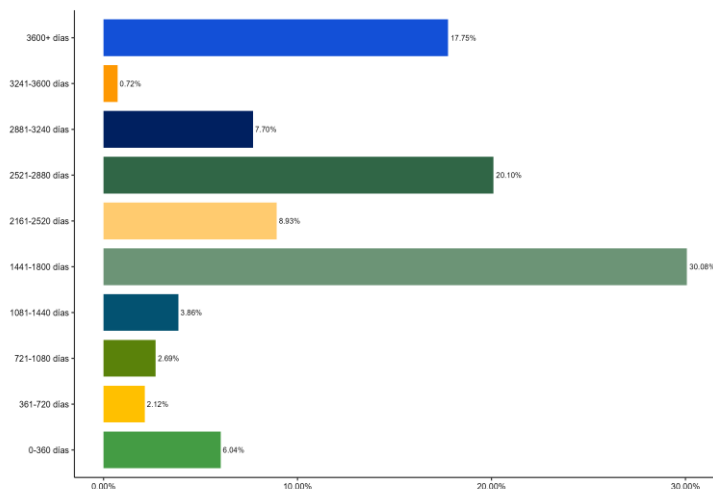
## SIEFORE INVERCAP BÁSICA 60 - 64

### RIESGO DE LIQUIDEZ

#### DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	262,188,951.90
361-720 días	92,203,187.58
721-1080 días	116,721,302.00
1081-1440 días	167,524,707.70
1441-1800 días	1,305,626,476.00
2161-2520 días	387,625,568.70
2521-2880 días	872,535,196.30
2881-3240 días	334,391,281.90
3241-3600 días	31,433,531.77
3600+ días	770,708,978.20
<b>TOTAL</b>	<b>4,340,959,182.05</b>

#### 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 SEPTIEMBRE DEL 2024)\*

**NOMINAL** **4.93%**

\*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-60-64>

### ESTRUCTURA DE COMISIONES

#### COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

#### COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL

**2024** **0.57%**