

# INDICADORES DE RIESGO SIEFORE INVERCAP BÁSICA 70 - 74

## RIESGO DE MERCADO

### VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.674500%
VaR Histórico (2)	0.754289%

(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

\$53,921,357,590.27

### 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	0.00	0.0000%
BB	0.00	0.0000%
BBB	2,555,446,050.17	4.7392%
A	2,329,578,953.29	4.3203%
AA	2,822,751,752.23	5.2349%
AAA	99,629,196.10	0.1848%
<b>TOTAL</b>	<b>7,807,405,951.79</b>	<b>14.4792%</b>

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

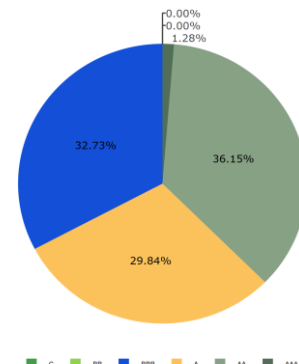


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

### 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	244,452,412.04	0.4533%
361-720 días	446,435,773.88	0.8279%
721-1092 días	2,300,968,137.46	4.2673%
1093-1820 días	1,411,833,052.53	2.8183%
1821-3600 días	1,315,143,522.68	2.4390%
Mas de 3600 días	2,088,573,053.20	3.8734%
Indefinido	0.00	0.0000%
<b>TOTAL</b>	<b>7,807,405,951.79</b>	<b>14.4792%</b>

Gráfico 2: Exposición por plazo

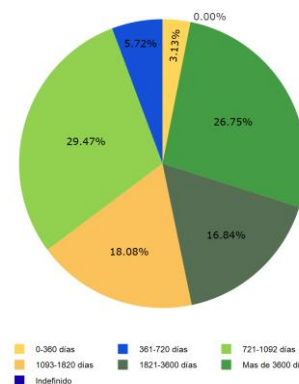


Gráfico 2: Exposición por plazo

### EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	247,403,855.29	0.4588%
Consumo Frecuente	1,397,625,811.20	2.5920%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	343,720,517.19	0.6374%
Peaje Carretero	1,484,691,019.46	2.7534%
Transporte	559,471,759.18	1.0378%
Energía	2,188,053,104.14	4.0579%
Consumo Discrecional	241,405,245.12	0.4477%
Real Estate	786,284,815.05	1.4582%
Hipotecas	0.00	0.0000%
Gobierno	558,750,025.16	1.0362%
<b>TOTAL</b>	<b>7,807,405,951.79</b>	<b>14.4792%</b>

Gráfico 3: Exposición por sector

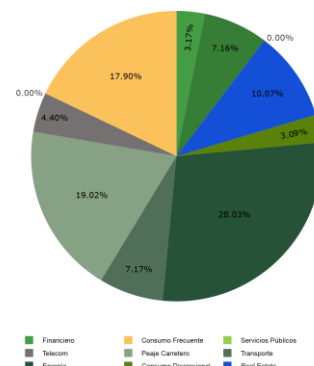


Gráfico 3: Exposición por sector

# INDICADORES DE RIESGO

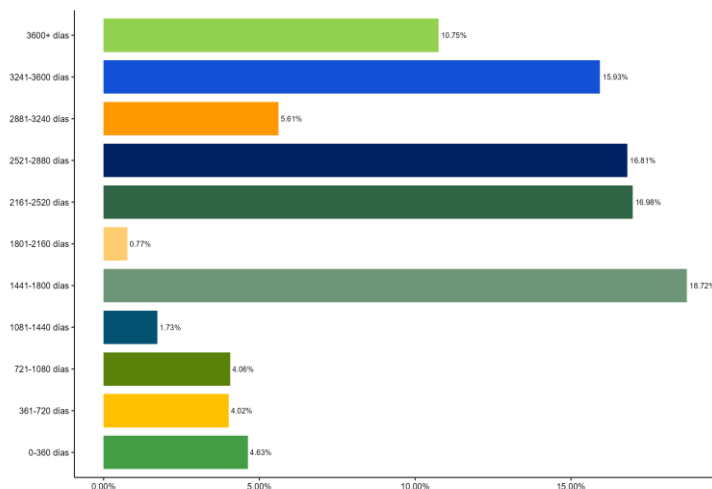
## SIEFORE INVERCAP BÁSICA 70 - 74

### RIESGO DE LIQUIDEZ

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

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	559,635,333.50
361-720 días	485,206,627.20
721-1080 días	490,535,232.90
1081-1440 días	208,556,929.70
1441-1800 días	2,261,020,086.00
1801-2160 días	92,639,041.72
2161-2520 días	2,050,617,251.00
2521-2880 días	2,030,025,863.00
2881-3240 días	678,045,965.20
3241-3600 días	1,923,546,280.00
3600+ días	1,298,007,032.00
<b>TOTAL</b>	<b>12,077,835,642.22</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** **5.04%**

\*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-70-74>

### ESTRUCTURA DE COMISIONES

#### COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

#### COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL

**2024** **0.57%**