

INDICADORES DE RIESGO

SIEFORE INVERCAP BÁSICA 60 - 64

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.559434%
VaR Histórico (2)	0.578681%

- (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

\$13,120,823,345.32

VaR PARAMÉTRICO VS VaR HISTÓRICO

VaR PARAMÉTRICO

0.559434%

VaR HISTÓRICO

0.578681%

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	1,360,718.70	0.0104%
BB	0.00	0.0000%
BBB	707,874,023.48	5.3950%
A	949,088,027.59	7.2334%
AA	1,296,064,601.58	9.8779%
AAA	91,351,068.16	0.6962%
TOTAL	3,045,738,439.51	23.2130%

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

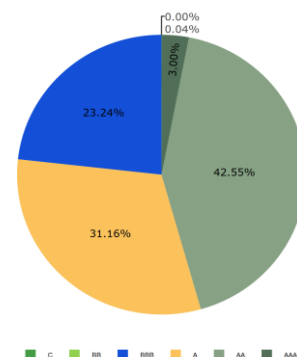


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

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	319,563,141.76	2.4355%
361-720 días	140,564,631.46	1.0713%
721-1092 días	1,111,636,926.53	8.4723%
1093-1820 días	194,491,715.54	1.4623%
1821-3600 días	407,459,512.69	3.1054%
Mas de 3600 días	871,307,685.37	6.6406%
Indefinido	714,846.26	0.0054%
TOTAL	3,045,738,439.51	23.2130%

Gráfico 2: Exposición por plazo

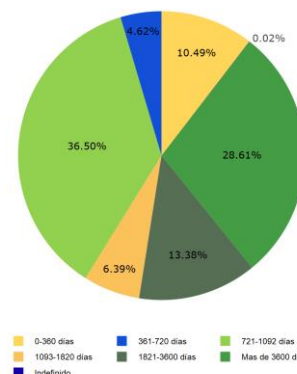


Gráfico 2: Exposición por plazo

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	256,757,446.98	1.9569%
Consumo Frecuente	536,215,425.36	4.0868%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	62,724,420.12	0.4781%
Peaje Carretero	617,130,495.53	4.7034%
Transporte	203,917,135.85	1.5541%
Energía	480,651,280.58	3.6633%
Consumo Discrecional	124,122,239.14	0.9460%
Real Estate	480,055,459.37	3.6587%
Hipotecas	1,360,718.70	0.0104%
Gobierno	282,803,817.68	2.1554%
TOTAL	3,045,738,439.51	23.2130%

Gráfico 3: Exposición por sector

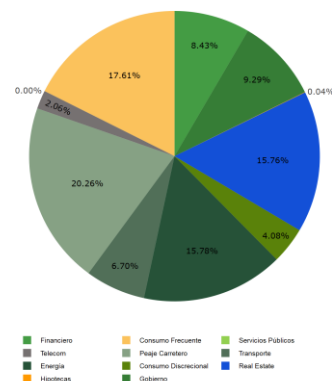


Gráfico 3: Exposición por sector

INDICADORES DE RIESGO

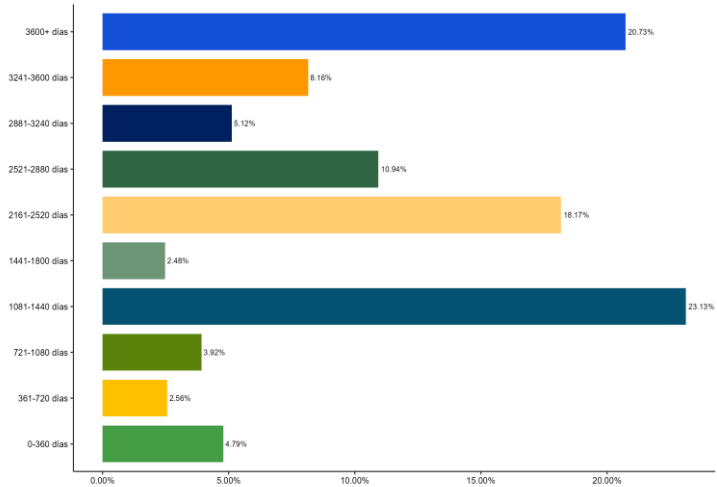
SIEFORE INVERCAP BÁSICA 60 - 64

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	173,612,326.00
361-720 días	93,036,718.76
721-1080 días	142,374,152.00
1081-1440 días	839,108,599.50
1441-1800 días	89,983,114.38
2161-2520 días	659,131,022.70
2521-2880 días	396,735,399.10
2881-3240 días	185,764,586.80
3241-3600 días	295,851,680.90
3600+ días	752,113,802.60
TOTAL	3,627,711,402.74

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 MARZO DEL 2025)*	
NOMINAL	5.56%

*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	
2025	0.55%