

INDICADORES DE RIESGO

SIEFORE INVERCAP BÁSICA 90 - 94

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.942709%
VaR Histórico (2)	1.064701%

- (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

\$21,586,032,385.39

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	25,737,564.40	0.1192%
BBB	638,049,938.15	2.9558%
A	502,575,027.51	2.3282%
AA	646,756,320.44	2.9962%
AAA	0.00	0.0000%
TOTAL	1,813,118,850.50	8.3995%

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

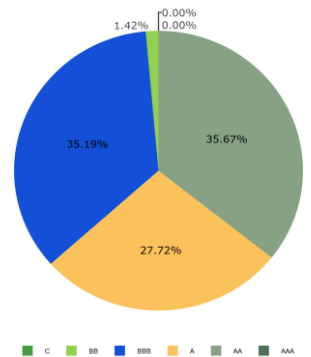


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

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	11,109,102.33	0.0515%
361-720 días	172,415,570.27	0.7987%
721-1092 días	170,201,715.39	0.7885%
1093-1820 días	416,318,225.06	1.9286%
1821-3600 días	633,582,235.52	2.9351%
Mas de 3600 días	409,492,001.93	1.8970%
Indefinido	0.00	0.0000%
TOTAL	1,813,118,850.50	8.3995%

Gráfico 2: Exposición por plazo

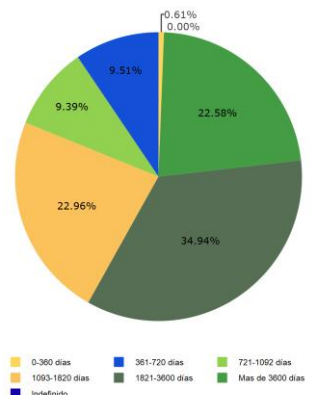


Gráfico 2: Exposición por plazo

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	51,277,815.62	0.2376%
Consumo Frecuente	126,985,083.54	0.5883%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	322,788,258.00	1.4954%
Peaje Carretero	183,902,740.63	0.8520%
Transporte	138,296,419.35	0.6453%
Energía	598,118,688.69	2.7709%
Consumo Discrecional	17,745,048.01	0.0822%
Real Estate	329,596,470.57	1.5269%
Hipotecas	0.00	0.0000%
Gobierno	43,498,328.09	0.2011%
TOTAL	1,813,118,850.50	8.3995%

Gráfico 3: Exposición por sector

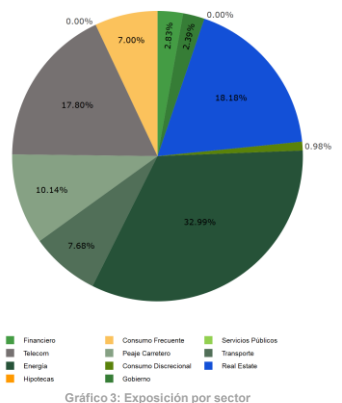


Gráfico 3: Exposición por sector

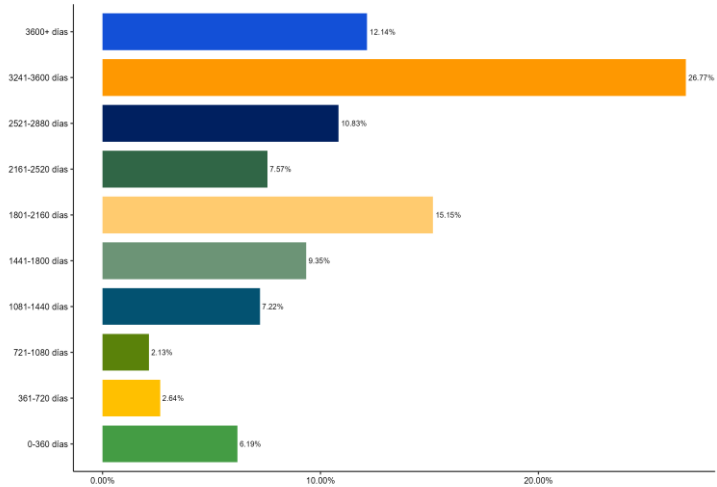
INDICADORES DE RIESGO
SIEFORE INVERCAP BÁSICA 90 - 94

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	250,931,046.70
361-720 días	107,138,808.90
721-1080 días	86,353,691.64
1081-1440 días	292,548,408.50
1441-1800 días	378,759,529.40
1801-2160 días	613,891,940.70
2161-2520 días	306,758,035.90
2521-2880 días	438,578,196.90
3241-3600 días	1,084,442,348.00
3600+ días	491,727,656.30
TOTAL	4,051,129,662.94

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 JUNIO DEL 2025)*	
NOMINAL	6.75%

*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-90-94>

ESTRUCTURA DE COMISIONES

COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL	
2025	0.55%