

INDICADORES DE RIESGO

SIEFORE INVERCAP BÁSICA INICIAL

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.956303%
VaR Histórico (2)	1.049724%

- (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

\$1,076,149,871.40

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	1,049,037.11	0.0975%
BBB	22,614,203.55	2.1014%
A	4,926,873.75	0.4578%
AA	6,950,626.96	0.6459%
AAA	545,281.56	0.0507%
TOTAL	36,086,022.93	3.3533%

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

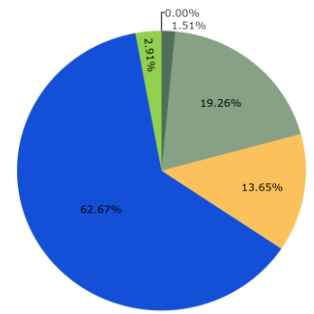


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

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	545,281.56	0.0507%
361-720 días	898,239.30	0.0835%
721-1092 días	4,232,480.62	0.3933%
1093-1820 días	8,356,596.55	0.7769%
1821-3600 días	13,680,775.47	1.2718%
Mas de 3600 días	8,366,649.43	0.7775%
Indefinido	0.00	0.0000%
TOTAL	36,086,022.93	3.3533%

Gráfico 2: Exposición por plazo

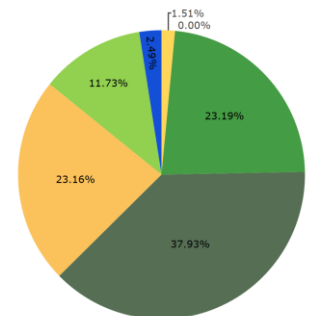


Gráfico 2: Exposición por plazo

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	1,354,852.20	0.1259%
Consumo Frecuente	1,304,639.44	0.1213%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	4,744,199.21	0.4408%
Peaje Carretero	2,540,868.85	0.2361%
Transporte	2,264,569.92	0.2104%
Energía	7,768,623.65	0.7219%
Consumo Discrecional	2,296,878.15	0.2134%
Real Estate	12,817,518.54	1.1911%
Hipotecas	0.00	0.0000%
Gobierno	993,872.97	0.0923%
TOTAL	36,086,022.93	3.3533%

Gráfico 3: Exposición por sector

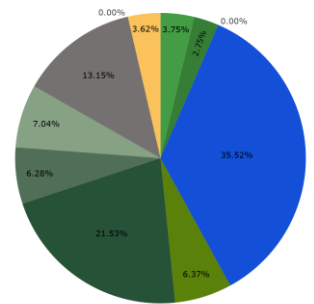


Gráfico 3: Exposición por sector

INDICADORES DE RIESGO

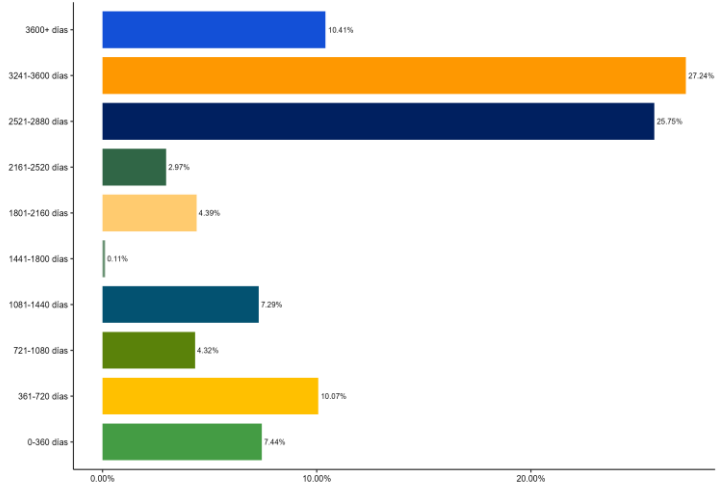
SIEFORE INVERCAP BÁSICA INICIAL

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	20,062,401.57
361-720 días	27,156,757.55
721-1080 días	11,640,762.30
1081-1440 días	19,670,630.37
1441-1800 días	305,151.64
1801-2160 días	11,850,665.60
2161-2520 días	8,017,455.41
2521-2880 días	69,458,683.25
3241-3600 días	73,461,040.41
3600+ días	28,067,698.62
TOTAL	269,691,246.72

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	6.50%

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

ESTRUCTURA DE COMISIONES

COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL	
2025	0.55%