

INDICADORES DE RIESGO

SIEFORE INVERCAP BÁSICA 75 - 79

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.896928%
VaR Histórico (2)	1.013509%

- (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

\$66,114,504,550.43

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	2,015,348.49	0.0030%
BB	0.00	0.0000%
BBB	948,234,626.71	1.4342%
A	3,454,611,891.85	5.2252%
AA	3,618,509,394.90	5.4731%
AAA	0.00	0.0000%
TOTAL	8,023,371,259.95	12.1356%

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

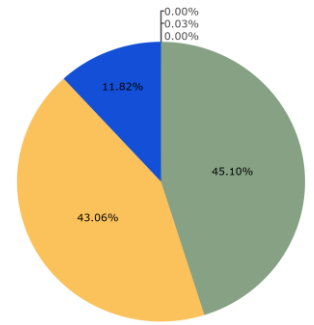


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

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	219,892,386.12	0.3326%
361-720 días	1,497,459,164.97	2.2649%
721-1092 días	605,915,913.42	0.9165%
1093-1820 días	949,992,484.05	1.4353%
1821-3600 días	1,996,713,743.23	3.0201%
Mas de 3600 días	2,753,687,406.99	4.1650%
Indefinido	760,181.17	0.0011%
TOTAL	8,023,371,259.95	12.1356%

Gráfico 2: Exposición por plazo

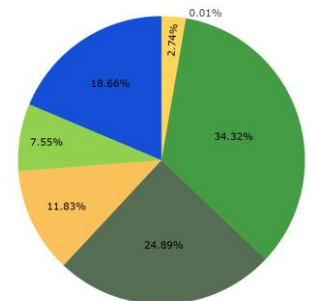


Gráfico 2: Exposición por plazo

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	306,891,804.11	0.4642%
Consumo Frecuente	468,950,596.75	0.7093%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	406,955,697.45	0.6155%
Peaje Carretero	1,620,229,903.04	2.4506%
Transporte	591,087,867.15	0.8940%
Energía	2,850,772,335.02	4.3119%
Consumo Discrecional	241,366,806.20	0.3651%
Real Estate	1,144,123,281.63	1.7305%
Hipotecas	2,015,346.49	0.0030%
Gobierno	378,293,469.61	0.5692%
Materiales	14,684,152.50	0.0222%
TOTAL	8,023,371,259.95	12.1356%

Gráfico 3: Exposición por sector

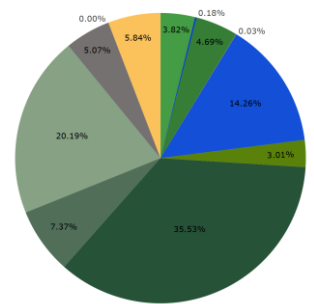


Gráfico 3: Exposición por sector

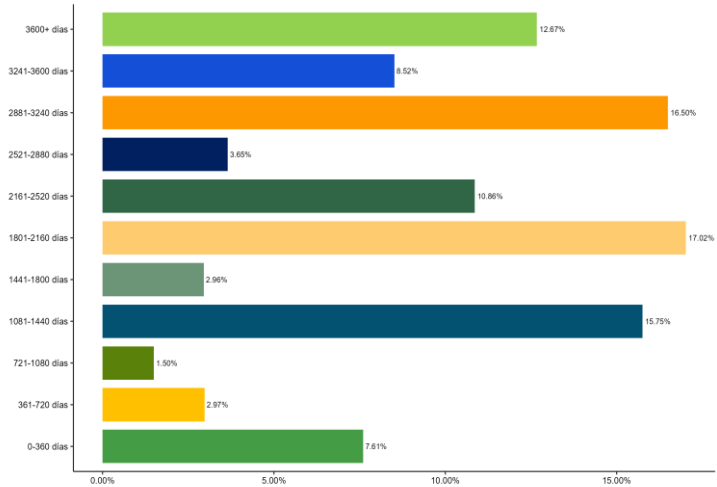
INDICADORES DE RIESGO
SIEFORE INVERCAP BÁSICA 75 - 79

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	839,088,580.70
361-720 días	328,191,930.20
721-1080 días	165,400,314.50
1081-1440 días	1,737,701,957.00
1441-1800 días	326,076,503.20
1801-2160 días	1,877,917,477.00
2161-2520 días	1,197,609,005.00
2521-2880 días	403,196,694.90
2881-3240 días	1,819,897,823.00
3241-3600 días	939,476,514.20
3600+ días	1,397,891,929.00
TOTAL	11,032,448,728.70

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 OCTUBRE DEL 2025)*	
NOMINAL	7.20%

*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-75-79>

ESTRUCTURA DE COMISIONES

COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL	
2025	0.55%