

INDICADORES DE RIESGO

SIEFORE INVERCAP BÁSICA 70 - 74

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.841807%
VaR Histórico (2)	0.947263%

- (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

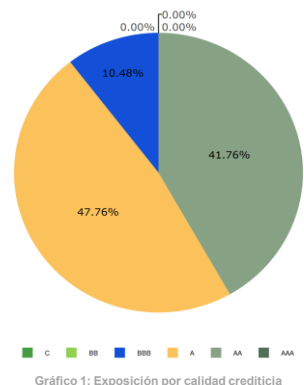


RIESGO DE CRÉDITO

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	723,333,699.66	1.0801%
A	3,297,954,569.93	4.9248%
AA	2,883,372,763.62	4.3057%
AAA	0.00	0.0000%
TOTAL	6,904,661,033.21	10.3106%

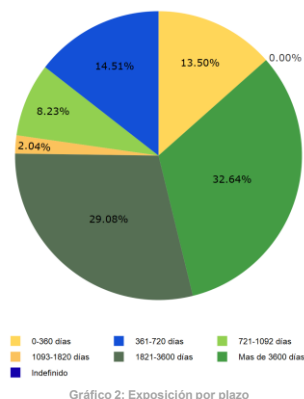
Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia



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	931,822,951.46	1.3915%
361-720 días	1,001,907,181.93	1.4961%
721-1092 días	568,463,480.42	0.8489%
1093-1820 días	140,821,455.95	0.2100%
1821-3600 días	2,007,934,772.27	2.9984%
Mas de 3600 días	2,253,911,211.58	3.3657%
Indefinido	0.00	0.0000%
TOTAL	6,904,661,033.21	10.3106%

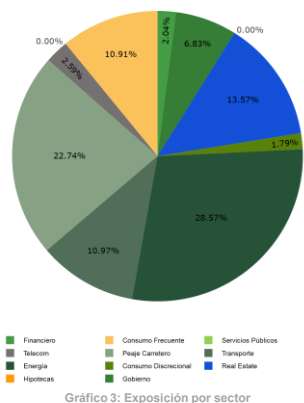
Gráfico 2: Exposición por plazo



EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	141,189,241.62	0.2108%
Consumo Frecuente	752,954,370.22	1.1244%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	178,963,322.55	0.2672%
Peaje Carretero	1,569,817,092.28	2.3442%
Transporte	757,114,476.36	1.1306%
Energía	1,972,382,865.95	2.9453%
Consumo Discrecional	123,512,720.02	0.1844%
Real Estate	936,997,272.23	1.3992%
Hipotecas	0.00	0.0000%
Gobierno	471,729,671.98	0.7044%
TOTAL	6,904,661,033.21	10.3106%

Gráfico 3: Exposición por sector



INDICADORES DE RIESGO

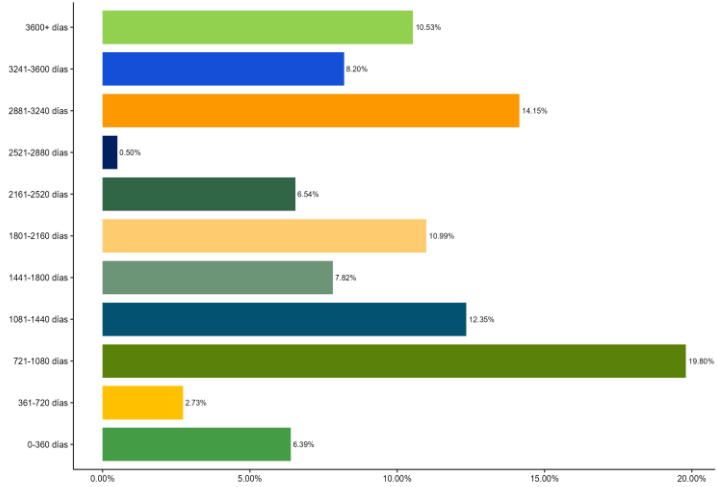
SIEFORE INVERCAP BÁSICA 70 - 74

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	817,732,679.67
361-720 días	349,693,533.34
721-1080 días	2,532,875,330.71
1081-1440 días	1,579,380,610.56
1441-1800 días	1,000,421,213.54
1801-2160 días	1,405,586,136.69
2161-2520 días	837,068,947.67
2521-2880 días	64,074,107.82
2881-3240 días	1,809,615,216.58
3241-3600 días	1,048,397,694.74
3600+ días	1,347,401,110.43
TOTAL	12,792,246,581.74

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 JULIO DEL 2026)*	
NOMINAL	7.93%

*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	
2026	0.54%