

INDICADORES DE RIESGO

SIEFORE INVERCAP BÁSICA 95 - 99

RIESGO DE MERCADO

VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	1.009331%
VaR Histórico (2)	1.072571%

(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

\$8,973,130,507.74

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	5,033,378.77	0.0561%
BBB	270,254,769.81	3.0118%
A	311,234,956.19	3.4685%
AA	152,082,977.36	1.6949%
AAA	0.00	0.0000%
TOTAL	738,606,082.13	8.2313%

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

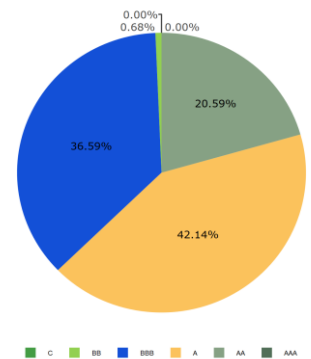


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

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	26,111,338.17	0.2910%
361-720 días	157,449,129.76	1.7547%
721-1092 días	89,951,365.13	1.0025%
1093-1820 días	81,992,196.57	0.9138%
1821-3600 días	284,439,071.59	3.1699%
Mas de 3600 días	98,662,980.91	1.0995%
Indefinido	0.00	0.0000%
TOTAL	738,606,082.13	8.2313%

Gráfico 2: Exposición por plazo

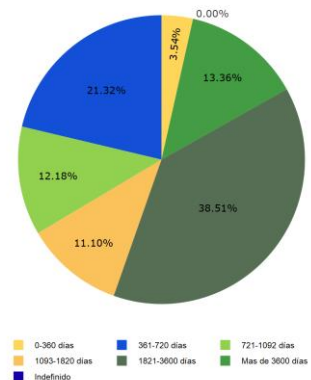


Gráfico 2: Exposición por plazo

EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	42,769,285.92	0.4766%
Consumo Frecuente	12,050,822.82	0.1343%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	72,042,045.72	0.8029%
Peaje Carretero	22,070,078.89	0.2460%
Transporte	88,585,760.76	0.9872%
Energía	182,329,493.70	2.0319%
Consumo Discrecional	95,389,211.44	1.0631%
Real Estate	182,718,371.80	2.0363%
Hipotecas	0.00	0.0000%
Gobierno	40,651,011.08	0.4530%
TOTAL	738,606,082.13	8.2313%

Gráfico 3: Exposición por sector

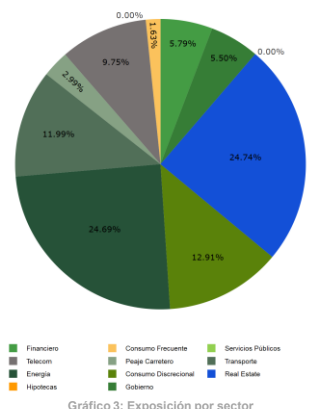


Gráfico 3: Exposición por sector

INDICADORES DE RIESGO

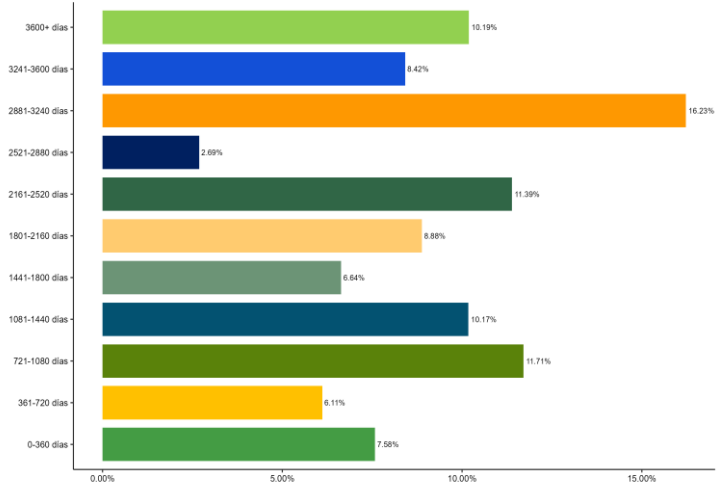
SIEFORE INVERCAP BÁSICA 95 - 99

RIESGO DE LIQUIDEZ

DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	120,128,527.66
361-720 días	96,840,856.13
721-1080 días	185,518,899.52
1081-1440 días	161,248,748.33
1441-1800 días	105,194,621.10
1801-2160 días	140,791,698.30
2161-2520 días	180,492,462.01
2521-2880 días	42,577,730.68
2881-3240 días	257,174,749.02
3241-3600 días	133,380,401.36
3600+ días	161,484,947.09
TOTAL	1,584,833,641.19

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	8.50%

*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-95-99>

ESTRUCTURA DE COMISIONES

COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL	
2026	0.54%