

# INDICADORES DE RIESGO

## SIEFORE INVERCAP BÁSICA DE PENSIONES

### RIESGO DE MERCADO

#### VALOR EN RIESGO (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
VaR Paramétrico (1)	0.243209%
VaR Histórico (2)	0.239720%

- (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](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

\$2,346,271,688.99

#### VaR PARAMÉTRICO VS VaR HISTÓRICO

VaR PARAMÉTRICO

0.243209%

VaR HISTÓRICO

0.239720%

### 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
BBB	11,888,134.26	0.5067%
A	21,200,840.46	0.9036%
AA	10,060,227.60	0.4288%
AAA	0.00	0.0000%
<b>TOTAL</b>	<b>43,149,002.32</b>	<b>1.8390%</b>

Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

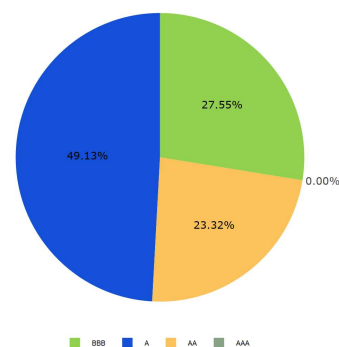


Gráfico 1: Exposición por calidad crediticia

#### 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	10,060,227.60	0.4288%
361-720 días	0.00	0.0000%
721-1092 días	18,623,932.11	0.7938%
1093-1820 días	14,464,842.61	0.6165%
1821-3600 días	0.00	0.0000%
Mas de 3600 días	0.00	0.0000%
Indefinido	0.00	0.0000%
<b>TOTAL</b>	<b>43,149,002.32</b>	<b>1.8390%</b>

Gráfico 2: Exposición por plazo

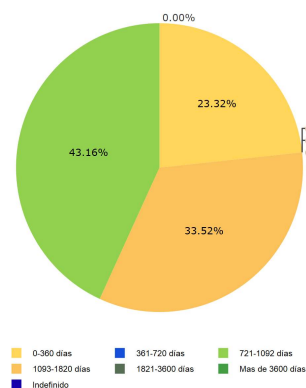


Gráfico 2: Exposición por plazo

#### EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO POR SECTOR

SECTOR	MONTO EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO	% CARTERA EXPUESTO A RIESGO DE CRÉDITO Vs ACTIVO TOTAL
Financiero	22,758,090.45	0.9700%
Consumo Frecuente	8,502,777.61	0.3624%
Servicios Públicos	0.00	0.0000%
Telecom	0.00	0.0000%
Peaje Carretero	0.00	0.0000%
Transporte	0.00	0.0000%
Energía	1,766,979.76	0.0753%
Consumo Discrecional	0.00	0.0000%
Real Estate	10,121,154.50	0.4314%
Hipotecas	0.00	0.0000%
Gobierno	0.00	0.0000%
<b>TOTAL</b>	<b>43,149,002.32</b>	<b>1.8390%</b>

Gráfico 3: Exposición por sector

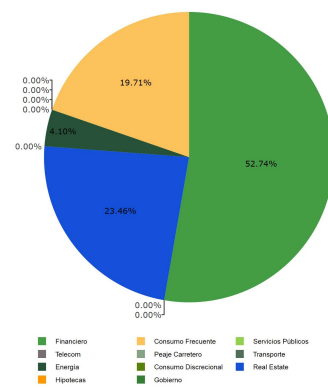


Gráfico 3: Exposición por sector

# INDICADORES DE RIESGO

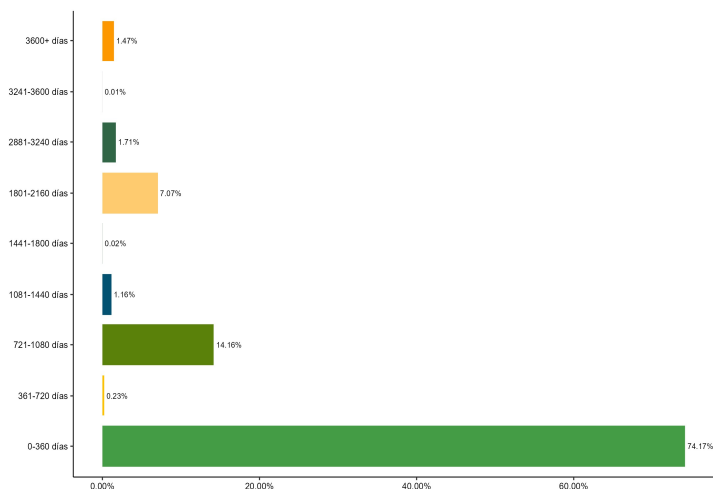
## SIEFORE INVERCAP BÁSICA DE PENSIONES

### RIESGO DE LIQUIDEZ

#### DESGLOSE DE MONTOS POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL (IMPORTE CON INTERESES)
0-360 días	268,360,562.40
361-720 días	838,538.76
721-1080 días	51,234,611.20
1081-1440 días	4,186,895.95
1441-1800 días	70,063.04
1801-2160 días	25,591,283.40
2881-3240 días	6,203,676.21
3241-3600 días	18,112.46
3600+ días	5,325,825.19
<b>TOTAL</b>	<b>361,829,568.61</b>

#### DESGLOSE POR PLAZO DE LOS VENCIMIENTOS



### RENDIMIENTO NETO

#### RENDIMIENTO NETO

RENDIMIENTO NETO (AL CIERRE DE ENERO DEL 2023)*	
<b>NOMINAL</b>	<b>5.05%</b>

\*Información obtenida de la página de CONSAR <https://www.gob.mx/consar/articulos/siefore-basica-de-pensiones-sb0>

### ESTRUCTURA DE COMISIONES

#### COMISIONES POR ADMINISTRACIÓN DE CUENTA INDIVIDUAL

COMISIÓN SOBRE SALDO ANUAL	
<b>2023</b>	<b>0.57%</b>