

Datos al 31 de julio de 2026

RIESGO DE MERCADO

Valor en Riesgo (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
CONTRIBUCIÓN AL VaR DE TASA NOMINAL	0.013393%
CUPÓN CERO TASA NOMINAL	0.000146%
TASA FIJA TASA NOMINAL	0.013198%
TASA VARIABLE NOMINAL	0.000049%
SUBYACENTE	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TASA REAL	0.008839%
CUPÓN CERO TASA REAL	0.000000%
TASA FIJA TASA REAL	0.008839%
TASA VARIABLE TASA REAL	0.000000%
SUBYACENTE TASA REAL	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TIPO DE CAMBIO	0.003083%
USD	0.003086%
EUR	0.000003%
JPY	0.000000%
OTROS	0.000000%
SUBYACENTE	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TÍTULOS ACCIONARIOS	0.504960%
SUBYACENTE	0.000000%
DERIVADOS	0.334112%
FUTUROS	0.334112%
VaR TOTAL*	0.835432%

* VaR Histórico con horizonte de tiempo a un día, 1000 observaciones y un nivel de confianza del 97.4%

Porcentajes con respecto al Activo Neto utilizado para la medición del VaR.

	VaR	C VaR	Diferencial CVaR
VaR HISTÓRICO *	0.835432%	1.133171%	0.421778%

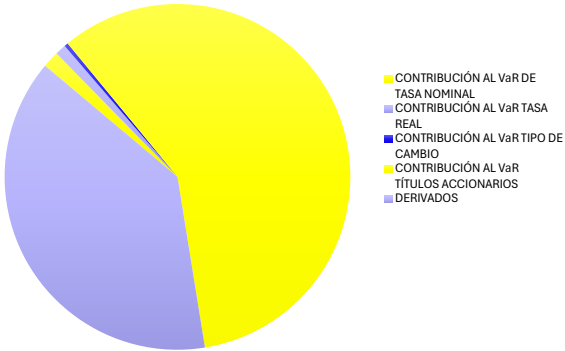
* VaR Histórico con horizonte de tiempo a un día, 1000 observaciones y un nivel de confianza del 97.4%

Porcentajes con respecto al Activo Neto utilizado para la medición del VaR.

Análisis de Sensibilidad

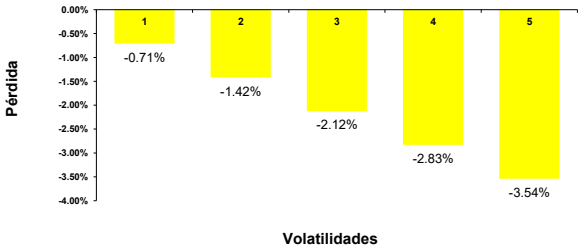
MOVIMIENTO EN VALOR DE MERCADO POR N VOLATILIDADES *	PÉRDIDA STRESS PORC
1	-0.71%
2	-1.42%
3	-2.12%
4	-2.83%
5	-3.54%

Contribución al VaR por factores de riesgo



ACTIVO NETO
31/07/2026
77,827,241,020.97

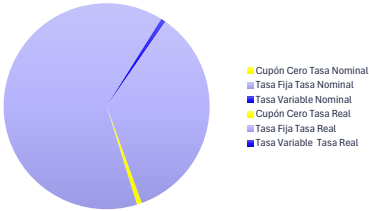
ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD



RIESGO DE CRÉDITO

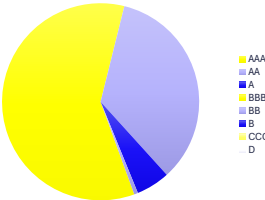
Exposición de Riesgo de Crédito por Tipo de Tasa

TIPO DE TASA	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO*
Cupón Cero Tasa Nominal	0.00%
Tasa Fija Tasa Nominal	0.07%
Tasa Variable Nominal	0.00%
Cupón Cero Tasa Real	0.00%
Tasa Fija Tasa Real	0.04%
Tasa Variable Tasa Real	0.00%
TOTAL	0.11%



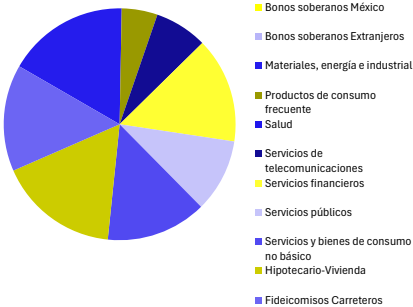
Exposición de Riesgo de Crédito por Calidad Crediticia

NIVEL DE CALIFICACIÓN	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO
AAA	0.07%
AA	0.04%
A	0.01%
BBB	0.00%
BB	0.00%
B	0.00%
CCC	0.00%
D	0.00%
TOTAL	0.11%



Exposición de Riesgo de Crédito por Sector

SECTOR	EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO
Bonos soberanos México	0.00%
Bonos soberanos Extranjeros	0.00%
Materiales, energía e industrial	0.02%
Productos de consumo frecuente	0.01%
Salud	0.00%
Servicios de telecomunicaciones	0.01%
Servicios financieros	0.02%
Servicios públicos	0.01%
Servicios y bienes de consumo no básico	0.02%
Hipotecario-Vivienda	0.02%
Fideicomisos Carreteros	0.02%
TOTAL	0.11%

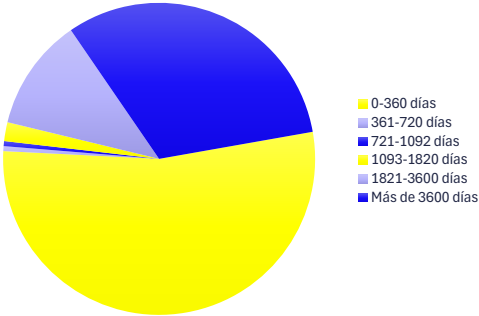


RIESGO DE LIQUIDEZ

Desglose por plazo de los vencimientos.

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL
0-360 días	0.57%
361-720 días	0.01%
721-1092 días	0.01%
1093-1820 días	0.02%
1821-3600 días	0.12%
Más de 3600 días	0.34%
TOTAL	1.06%

Desglose por plazo de los vencimientos



RENDIMIENTO

Cifras al cierre de junio de 2026
7.17%

ESTRUCTURA DE COMISIONES

Comisiones por administración de cuenta individual

COMISIONES VARIABLES	
Conceptos	Comisión
Comisión sobre Saldo	0.54% anual sobre el saldo administrado

COMISIONES POR CUOTA FIJA	
Conceptos	Comisión
Pago de Retiros Programados	Sin comisión
Aportaciones voluntarias	Sin comisión
Estados de cuenta adicionales	Sin comisión
Reposición de documentos	Sin comisión

INDICADORES DE RIESGO RENDIMIENTO

ERROR DE SEGUIMIENTO ANUALIZADO	2.30%
------------------------------------	-------

PONDERACIÓN POR CLASE DE ACTIVO

Comparación de las ponderaciones de la Trayectoria de Inversión con respecto a la cartera de inversión de la Sociedad de Inversión

COMPOSICIÓN POR CLASE DE ACTIVO	TRAYECTORIA DE INVERSIÓN	SOCIEDAD DE INVERSIÓN
GUBERNAMENTAL	29.31%	27.57%
DEUDA CORPORATIVA	14.99%	18.85%
BURSATILIZADOS	0.04%	1.83%
REPO	0.00%	2.88%
VALORES EXTRANJEROS DE DEUDA	0.00%	0.00%
RENTA VARIABLE NACIONAL	9.53%	9.03%
RENTA VARIABLE EXTRANJERA	19.05%	15.48%
ESTRUCTURADO	19.14%	15.30%
FIBRAS	7.94%	7.67%
TIPO DE CAMBIO	0.00%	1.46%
OTROS	0.00%	0.00%