

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     | 0.010346%    |
| CUPÓN CERO TASA NOMINAL                 | 0.000792%    |
| TASA FIJA TASA NOMINAL                  | 0.011138%    |
| TASA VARIABLE NOMINAL                   | 0.000000%    |
| SUBYACENTE                              | 0.000000%    |
| CONTRIBUCIÓN AL VaR TASA REAL           | 0.100753%    |
| CUPÓN CERO TASA REAL                    | 0.000000%    |
| TASA FIJA TASA REAL                     | 0.100753%    |
| TASA VARIABLE TASA REAL                 | 0.000000%    |
| SUBYACENTE TASA REAL                    | 0.000000%    |
| CONTRIBUCIÓN AL VaR TIPO DE CAMBIO      | 0.014571%    |
| USD                                     | 0.014568%    |
| EUR                                     | 0.000003%    |
| JPY                                     | 0.000000%    |
| OTROS                                   | 0.000000%    |
| SUBYACENTE                              | 0.000000%    |
| CONTRIBUCIÓN AL VaR TÍTULOS ACCIONARIOS | 0.585099%    |
| SUBYACENTE                              | 0.000000%    |
| DERIVADOS                               | 0.435761%    |
| FUTUROS                                 | 0.435761%    |
| VaR TOTAL*                              | 0.943955%    |

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

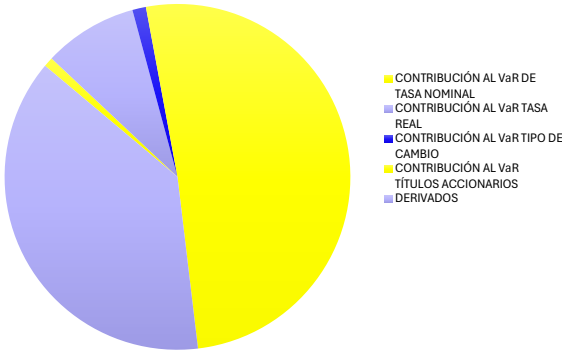
Porcentajes con respecto al Activo Neto utilizado para la medición del VaR.

|                 | VaR       | C VaR     | Diferencial CVaR |
|-----------------|-----------|-----------|------------------|
| VaR HISTÓRICO * | 0.943955% | 1.279658% | 0.564335%        |

\* 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.

Contribución al VaR por factores de riesgo

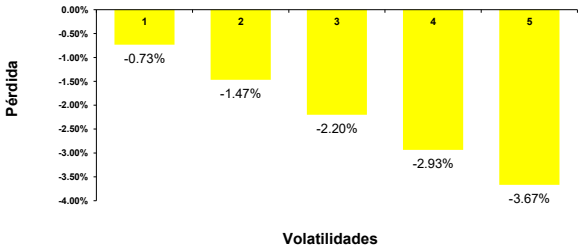


| ACTIVO NETO        |
|--------------------|
| 31/07/2026         |
| 101,929,002,019.08 |

Análisis de Sensibilidad

| MOVIMIENTO EN VALOR DE MERCADO POR N VOLATILIDADES * | PÉRDIDA STRESS PORC |
|------------------------------------------------------|---------------------|
| 1                                                    | -0.73%              |
| 2                                                    | -1.47%              |
| 3                                                    | -2.20%              |
| 4                                                    | -2.93%              |
| 5                                                    | -3.67%              |

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

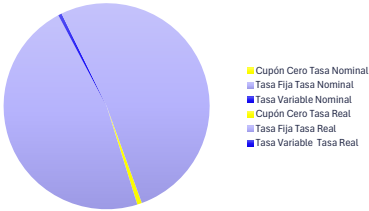


Datos al 31 de julio de 2026

RIESGO DE CRÉDITO

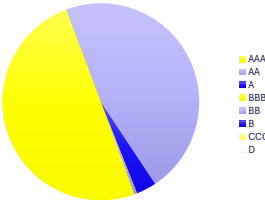
Exposición de Riesgo de Crédito por Tipo de Tasa

| TIPO DE TASA            | EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO* |
|-------------------------|---------------------------------------------------|
| Cupón Cero Tasa Nominal | 0.00%                                             |
| Tasa Fija Tasa Nominal  | 0.06%                                             |
| Tasa Variable Nominal   | 0.00%                                             |
| Cupón Cero Tasa Real    | 0.00%                                             |
| Tasa Fija Tasa Real     | 0.07%                                             |
| Tasa Variable Tasa Real | 0.00%                                             |
| TOTAL                   | 0.14%                                             |



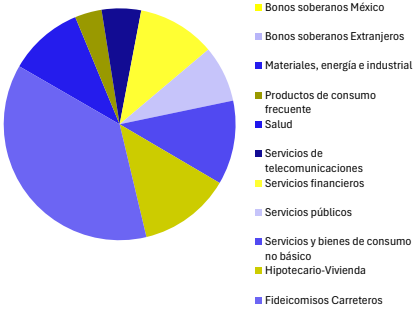
Exposición de Riesgo de Crédito por Calidad Crediticia

| NIVEL DE CALIFICACIÓN | EXPOSICIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO % Vs ACTIVO NETO |
|-----------------------|--------------------------------------------------|
| AAA                   | 0.07%                                            |
| AA                    | 0.06%                                            |
| A                     | 0.00%                                            |
| BBB                   | 0.00%                                            |
| BB                    | 0.00%                                            |
| B                     | 0.00%                                            |
| CCC                   | 0.00%                                            |
| D                     | 0.00%                                            |
| TOTAL                 | 0.14%                                            |



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        | 0.01%                                            |
| Productos de consumo frecuente          | 0.01%                                            |
| Salud                                   | 0.00%                                            |
| Servicios de telecomunicaciones         | 0.01%                                            |
| Servicios financieros                   | 0.01%                                            |
| Servicios públicos                      | 0.01%                                            |
| Servicios y bienes de consumo no básico | 0.02%                                            |
| Hipotecario-Vivienda                    | 0.02%                                            |
| Fideicomisos Carreteros                 | 0.05%                                            |
| TOTAL                                   | 0.14%                                            |

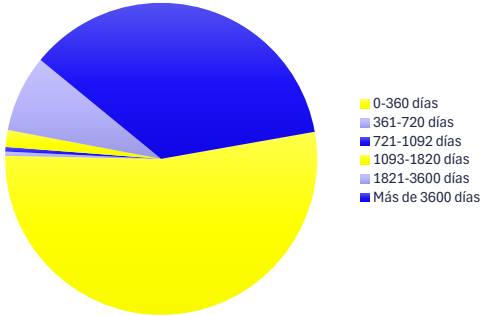


RIESGO DE LIQUIDEZ

Desglose por plazo de los vencimientos.

| PLAZO AL VENCIMIENTO | TOTAL |
|----------------------|-------|
| 0-360 días           | 0.57% |
| 361-720 días         | 0.00% |
| 721-1092 días        | 0.01% |
| 1093-1820 días       | 0.02% |
| 1821-3600 días       | 0.09% |
| Más de 3600 días     | 0.39% |
| TOTAL                | 1.07% |

Desglose por plazo de los vencimientos



RENDIMIENTO

| Cifras al cierre de junio de 2026 |
|-----------------------------------|
| 7.32%                             |

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<br>ANUALIZADO | 2.86% |
|------------------------------------|-------|

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                   | 20.15%                   | 26.67%                |
| DEUDA CORPORATIVA               | 14.98%                   | 17.78%                |
| BURSATILIZADOS                  | 0.01%                    | 3.11%                 |
| REPO                            | 0.00%                    | 2.87%                 |
| VALORES EXTRANJEROS DE DEUDA    | 0.00%                    | 0.00%                 |
| RENTA VARIABLE NACIONAL         | 16.51%                   | 9.33%                 |
| RENTA VARIABLE EXTRANJERA       | 20.00%                   | 16.54%                |
| ESTRUCTURADO                    | 20.00%                   | 13.89%                |
| FIBRAS                          | 8.35%                    | 7.65%                 |
| TIPO DE CAMBIO                  | 0.00%                    | 2.26%                 |
| OTROS                           | 0.00%                    | 0.00%                 |