Indicadores de Riesgo de la Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. - SB 90-4

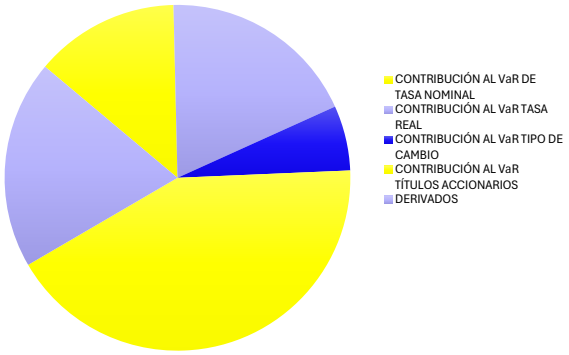
Datos al 30 de septiembre de 2026

RIESGO DE MERCADO

Valor en Riesgo (VaR)

TIPO DE RIESGO	VaR DIARIO %
CONTRIBUCIÓN AL VaR DE TASA NOMINAL	**0.140129%**
CUPÓN CERO TASA NOMINAL	0.003798%
TASA FIJA TASA NOMINAL	0.136393%
TASA VARIABLE NOMINAL	0.000061%
SUBYACENTE	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TASA REAL	**0.192901%**
CUPÓN CERO TASA REAL	0.000000%
TASA FIJA TASA REAL	0.192901%
TASA VARIABLE TASA REAL	0.000000%
SUBYACENTE TASA REAL	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TIPO DE CAMBIO	**0.063026%**
USD	0.062525%
EUR	0.000501%
JPY	0.000000%
OTROS	0.000000%
SUBYACENTE	0.000000%
CONTRIBUCIÓN AL VaR TÍTULOS ACCIONARIOS	**0.438149%**
SUBYACENTE	0.000000%
DERIVADOS	**0.202254%**
FUTUROS	0.202254%
VaR TOTAL*	**0.873476%**

Contribución al VaR por factores de riesgo



ACTIVO NETO
30/09/2026
119,102,626,343.90

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

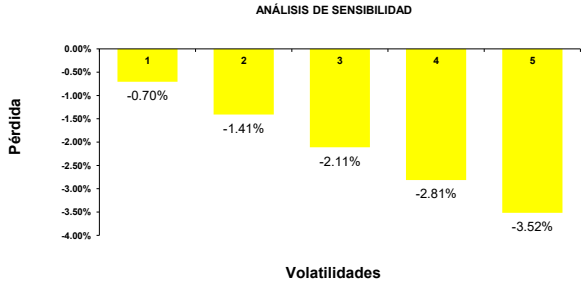
Porcentajes con respecto al Activo Neto utilizado para la medición del VaR.

	VaR	C VaR	Diferencial CVaR
VaR HISTÓRICO *	**0.873476%**	**1.221210%**	**0.637056%**

* 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	-0.70%
2	-1.41%
3	-2.11%
4	-2.81%
5	-3.52%



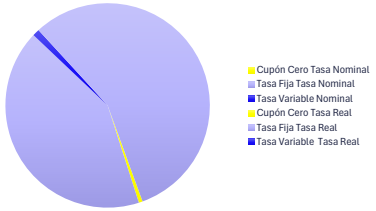
Indicadores de Riesgo de la Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. - SB 90-4

Datos al 30 de septiembre de 2026

RIESGO DE CRÉDITO

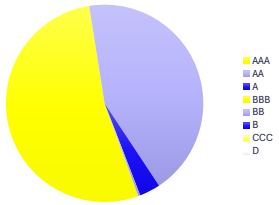
Exposición de Riesgo de Crédito por Tipo de Tasa

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	0.08%
Tasa Variable Tasa Real	0.00%
TOTAL	**0.14%**



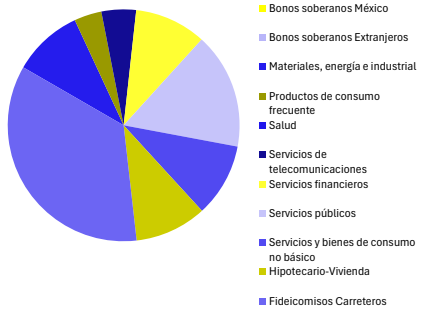
Exposición de Riesgo de Crédito por Calidad Crediticia

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	0.02%
Servicios y bienes de consumo no básico	0.01%
Hipotecario-Vivienda	0.01%
Fideicomisos Carreteros	0.05%
TOTAL	**0.14%**



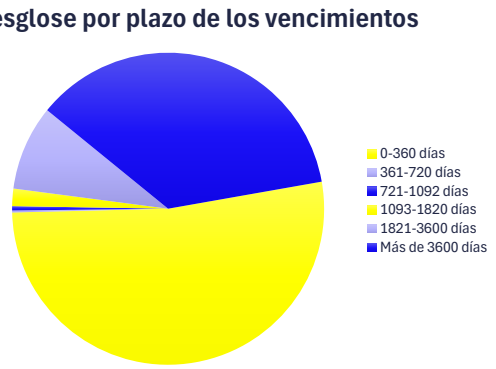
Indicadores de Riesgo de la Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. - SB 90-4

Datos al 30 de septiembre de 2026

RIESGO DE LIQUIDEZ

Desglose por plazo de los vencimientos.

PLAZO AL VENCIMIENTO	TOTAL
0-360 días	0.50%
361-720 días	0.00%
721-1092 días	0.00%
1093-1820 días	0.02%
1821-3600 días	0.08%
Más de 3600 días	0.35%
TOTAL	**0.95%**



Indicadores de Riesgo de la Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. - SB 90-4

Datos al 30 de septiembre de 2026

RENDIMIENTO

Cifras al cierre de agosto de 2026
7.51%

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 de la Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. - SB 90-4

Datos al 30 de septiembre de 2026

INDICADORES DE RIESGO RENDIMIENTO

ERROR DE SEGUIMIENTO ANUALIZADO	3.12%

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	15.48%	26.32%
DEUDA CORPORATIVA	14.98%	17.46%
BURSATILIZADOS	0.00%	2.88%
REPO	0.00%	3.68%
VALORES EXTRANJEROS DE DEUDA	0.00%	0.00%
RENTA VARIABLE NACIONAL	21.07%	8.33%
RENTA VARIABLE EXTRANJERA	20.00%	17.81%
ESTRUCTURADO	20.00%	13.57%
FIBRAS	8.47%	7.41%
TIPO DE CAMBIO	0.00%	2.54%
OTROS	0.00%	0.00%