

ORION

ACTIPLAZO S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSION
EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

DISCRECIONAL

HR Ratings de México, S.A. De C.V.

AAA/4CP

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				517,142,976	17.60%
M	BONOS	280302	AAA(mex)	313,546,842	10.67%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	203,596,134	6.93%
Certificados Bursátiles Corporativos				327,161,250	11.14%
91	LALA	18	AA (mex)	101,363,943	3.45%
91	GAP	24-2L	mxAAA	87,411,196	2.98%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	52,108,303	1.77%
91	TPLAYCB	24	HR AA-	44,975,386	1.53%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41,302,422	1.41%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,357,879,397	46.22%
BI	CETES	260528	AAA(mex)	544,719,687	18.54%
BI	CETES	270902	AAA(mex)	534,770,775	18.20%
BI	CETES	261210	AAA(mex)	133,802,826	4.55%
BI	CETES	260625	AAA(mex)	96,746,240	3.29%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	47,839,870	1.63%
Chequera Dolares				169,287	0.01%
CHD	40-133	8034712		169,287	0.01%
Titulos de Credito Extranjeros				43,561,571	1.48%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	43,561,571	1.48%
Udibonos				152,843,849	5.20%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	100,468,871	3.42%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	52,374,978	1.78%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				82,189,425	2.80%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	82,189,425	2.80%
Reportos				457,159,616	15.56%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	441,154,698	15.02%
LF	BONDESF	270520	AAA(mex)	16,004,919	0.55%

TOTAL CARTERA	2,938,107,371	100.00%
ACTIVO NETO	2,941,096,634	

Cartera al: 08/01/2026

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.054 %

Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y con una muestra de 252 observaciones.

"El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en éste fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimientos de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto."