

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				571,086,737	19.29%
M	BONOS	280302	AAA(mex)	314,647,686	10.63%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	204,167,350	6.90%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	52,271,701	1.77%
Certificados Bursátiles Corporativos				328,010,205	11.08%
91	LALA	18	AA (mex)	101,730,651	3.44%
91	GAP	24-2L	mxAAA	87,655,832	2.96%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	52,037,359	1.76%
91	TPLAYCB	24	HR AA-	45,157,322	1.53%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41,429,041	1.40%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,361,748,446	46.00%
BI	CETES	260528	AAA(mex)	546,273,934	18.46%
BI	CETES	270902	AAA(mex)	536,210,541	18.12%
BI	CETES	261210	AAA(mex)	134,242,391	4.54%
BI	CETES	260625	AAA(mex)	97,038,420	3.28%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	47,983,160	1.62%
Chequera Dólares				164,546	0.01%
CHD	40-133	8034712		164,546	0.01%
Títulos de Credito Extranjeros				41,656,925	1.41%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	41,656,925	1.41%
Udibonos				153,234,248	5.18%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	100,719,877	3.40%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	52,514,371	1.77%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				82,703,243	2.79%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	82,703,243	2.79%
Reportos				421,450,606	14.24%
IM	BPAG28	270805	AAA(mex)	421,450,606	14.24%

TOTAL CARTERA	2,960,054,956	100.00%
ACTIVO NETO	2,953,025,927	

Cartera al: 22/01/2026

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."