

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				304.816.563	8,66%
M	BONOS	280302	AAA(mex)	304.816.563	8,66%
Certificados Bursátiles Corporativos				510.776.619	14,52%
91	LALA	18	AA (mex)	98.330.914	2,79%
91	GAP	24-2L	mxAAA	88.065.293	2,50%
91	KOF	26	mxAAA	68.082.304	1,94%
91	BIMBO	26	AAA (mex)	58.360.555	1,66%
91	ACBE	26-2	AAA (mex)	58.285.641	1,66%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	52.677.174	1,50%
91	TPLAYCB	24	HR AA-	45.053.298	1,28%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41.921.440	1,19%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1.382.073.288	39,27%
BI	CETES	260528	AAA(mex)	551.734.461	15,68%
BI	CETES	270902	AAA(mex)	540.501.688	15,36%
BI	CETES	261210	AAA(mex)	135.573.645	3,85%
BI	CETES	260625	AAA(mex)	97.990.110	2,79%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	48.462.135	1,38%
BI	CETES	280217	AAA(mex)	7.811.250	0,22%
Chequera Dólares				168.001	0,01%
CHD	40-133	8034712		168.001	0,01%
Títulos de Credito Extranjeros				42.051.787	1,20%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	42.051.787	1,20%
Udibonos				154.668.864	4,40%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	101.763.520	2,89%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	52.905.344	1,50%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				83.433.370	2,37%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	83.433.370	2,37%
Reportos				1.041.078.507	29,58%
IQ	BPAG91	290111	AAA(mex)	695.230.874	19,76%
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	345.847.633	9,83%

TOTAL CARTERA	3.519.066.999	100,00%
ACTIVO NETO	3.514.550.870	

Cartera al: 12/03/2026

Límite Máximo de VaR: 0,830 % Var Promedio: 0,074 %

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."