

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			616,634,837	17.53%
M	BONOS	280302	AAA(mex)	305,017,353	8.67%
M	BONOS	300228	AAA(mex)	144,951,592	4.12%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	51,382,729	1.46%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	47,444,104	1.35%
M	BONOS	320415	AAA(mex)	19,773,850	0.56%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	18,817,702	0.54%
M	BONOS	360221	AAA(mex)	18,444,963	0.52%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	10,802,544	0.31%
	Certificados Bursátiles Corporativos			506,103,423	14.38%
91	LALA	18	AA (mex)	98,440,500	2.80%
91	GAP	24-2L	mxAAA	83,570,372	2.38%
91	KOF	26	mxAAA	68,033,958	1.93%
91	BIMBO	26	AAA (mex)	58,338,874	1.66%
91	ACBE	26-2	AAA (mex)	58,306,529	1.66%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	52,705,975	1.50%
91	TPLAYCB	24	HR AA-	44,884,426	1.28%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41,822,790	1.19%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,771,369,897	50.35%
BI	CETES	260528	AAA(mex)	553,909,937	15.74%
BI	CETES	270902	AAA(mex)	541,614,015	15.39%
BI	CETES	280217	AAA(mex)	392,552,916	11.16%
BI	CETES	261210	AAA(mex)	136,242,190	3.87%
BI	CETES	260625	AAA(mex)	98,394,660	2.80%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	48,656,180	1.38%
	Chequera Dólares			168,766	0.01%
CHD	40-133	8034712		168,766	0.01%
	Títulos de Credito Extranjeros			42,029,894	1.20%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	42,029,894	1.20%

	Udibonos			154,820,397	4.40%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	102,727,022	2.92%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	52,093,375	1.48%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			83,785,587	2.38%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	83,785,587	2.38%
	Reportos			343,541,546	9.76%
IM	BPAG28	270204	AAA(mex)	290,950,784	8.27%
IQ	BPAG91	300912	AAA(mex)	52,590,761	1.50%
	TOTAL CARTERA			3,518,454,347	100.00%
	ACTIVO NETO			3,464,873,481	

Cartera al: 31/03/2026

Límite Máximo de VaR: 0.830 % **Var Promedio:** 0.097 %

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."