



ORION

Actiplazo, S.A. de C.V. Fondo de
Inversión en Instrumentos de Deuda

DISCRECIONAL					
HR Ratings de México, S.A. De C.V.				AAA/3CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			1,420,668,988	61.50%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	526,819,808	22.81%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	150,386,301	6.51%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	128,245,566	5.55%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	115,461,406	5.00%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	107,661,232	4.66%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	103,028,571	4.46%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	102,274,272	4.43%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	90,179,550	3.90%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	44,754,868	1.94%
M	BONOS	471107	AAA(mex)	43,470,180	1.88%
M	BONOS	530731	AAA(mex)	8,387,235	0.36%
	Certificados Bursátiles Corporativos			244,103,011	10.57%
91	LALA	18	AA (mex)	90,230,650	3.91%
91	GAP	24-2L	mxAAA	82,084,491	3.55%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	40,875,325	1.77%
91	BRX	22	AAA (mex)	19,900,831	0.86%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,011,715	0.48%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			98,751,900	4.28%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	98,751,900	4.28%
	Chequera Dolares			1,087,548	0.05%
CHD	40-133	8034712		1,087,548	0.05%
	Titulos de Credito Extranjeros			39,558,982	1.71%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	39,558,982	1.71%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			20,160,445	0.87%
93	TPLAY	00223	HR2	20,160,445	0.87%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			223,893,788	9.69%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	149,009,543	6.45%

95	CFE	20-2	AAA (mex)	74,884,245	3.24%
	Reportos			261,682,303	11.33%
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	261,682,303	11.33%
	TOTAL CARTERA			2,309,906,965	100.00%
	ACTIVO NETO			2,309,042,810	

Cartera al: 02/05/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % **Var Promedio:** 0.266 %
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."