



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			1,330,984,411	56.78%
M	BONOS	240905	AAA(mex)	536,451,478	22.88%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	206,253,399	8.80%
M	BONOS	260903	AAA(mex)	152,890,094	6.52%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	109,646,142	4.68%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	98,982,201	4.22%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	94,396,754	4.03%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	86,942,326	3.71%
M	BONOS	270304	AAA(mex)	45,422,018	1.94%
	Certificados Bursátiles Corporativos			245,380,933	10.47%
91	LALA	18	AA (mex)	91,720,719	3.91%
91	GAP	24-2L	mxAAA	83,031,609	3.54%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	39,097,072	1.67%
91	BRX	22	AAA (mex)	20,312,607	0.87%
91	FUNO	15	AAA (mex)	11,218,926	0.48%
	Chequera Dolares			206	0.00%
CHD	40-133	8034712		206	0.00%
	Titulos de Credito Extranjeros			40,118,129	1.71%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	40,118,129	1.71%
	Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial			20,181,352	0.86%
93	TPLAY	00223	HR2	20,181,352	0.86%
	Udibonos			16,299,165	0.70%
S	UDIBONO	541029	AAA(mex)	16,299,165	0.70%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			229,299,145	9.78%
95	PEMEX	13-2	mxAAA	151,879,879	6.48%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	77,419,267	3.30%
	Reportos			462,039,069	19.71%

IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	462,039,069	19.71%
TOTAL CARTERA				2,344,302,410	100.00%
ACTIVO NETO				2,343,454,561	

Cartera al: 28/06/2024

Límite Máximo de VaR: 0.830 % Var Promedio: 0.252 %
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."