

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/4CP	
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			573,467,199	19.35%
M	BONOS	280302	AAA(mex)	316,244,154	10.67%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	204,606,162	6.91%
M	BONOS	290301	AAA(mex)	52,616,883	1.78%
	Certificados Bursátiles Corporativos			329,531,386	11.12%
91	LALA	18	AA (mex)	102,266,642	3.45%
91	GAP	24-2L	mxAAA	88,241,850	2.98%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	52,351,090	1.77%
91	TPLAYCB	24	HR AA-	44,915,912	1.52%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	41,755,894	1.41%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			1,365,862,661	46.09%
BI	CETES	260528	AAA(mex)	547,502,279	18.48%
BI	CETES	270902	AAA(mex)	538,372,245	18.17%
BI	CETES	261210	AAA(mex)	134,609,477	4.54%
BI	CETES	260625	AAA(mex)	97,273,480	3.28%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	48,105,180	1.62%
	Chequera Dólares			163,985	0.01%
CHD	40-133	8034712		163,985	0.01%
	Títulos de Credito Extranjeros			41,923,271	1.42%
JE	AMX	0129	AAA (mex)	41,923,271	1.42%
	Udibonos			153,471,808	5.18%
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	100,855,733	3.40%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	52,616,075	1.78%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			82,878,060	2.80%
95	CFE	20-2	AAA (mex)	82,878,060	2.80%
	Reportos			415,995,320	14.04%
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	415,995,320	14.04%
	TOTAL CARTERA			2,963,293,690	100.00%
	ACTIVO NETO			2,956,237,548	

Cartera al:

30/01/2026

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."