

# 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	%
	<b>Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija</b>			<b>630.420.256</b>	<b>18,66%</b>
M	BONOS	280302	AAA(mex)	311.726.784	9,23%
M	BONOS	300228	AAA(mex)	148.676.432	4,40%
M	BONOS	290531	AAA(mex)	52.708.884	1,56%
M	BONOS	381118	AAA(mex)	48.754.063	1,44%
M	BONOS	320415	AAA(mex)	19.449.655	0,58%
M	BONOS	341123	AAA(mex)	19.161.236	0,57%
M	BONOS	360221	AAA(mex)	18.876.340	0,56%
M	BONOS	361120	AAA(mex)	11.066.863	0,33%
	<b>Certificados Bursátiles Corporativos</b>			<b>514.979.536</b>	<b>15,24%</b>
91	LALA	18	AA (mex)	100.726.029	2,98%
91	GAP	24-2L	mxAAA	86.054.152	2,55%
91	KOF	26	mxAAA	69.651.451	2,06%
91	ACBE	26-2	AAA (mex)	59.542.165	1,76%
91	BIMBO	26	AAA (mex)	59.480.519	1,76%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	51.446.573	1,52%
91	TPLAYCB	24	HR AA-	44.923.453	1,33%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	43.155.194	1,28%
	<b>Certificados De La Tesorería De La Federación</b>			<b>1.282.947.765</b>	<b>37,97%</b>
BI	CETES	270902	AAA(mex)	552.072.377	16,34%
BI	CETES	280217	AAA(mex)	400.575.541	11,86%
BI	CETES	261210	AAA(mex)	138.065.247	4,09%
BI	CETES	260625	AAA(mex)	99.566.490	2,95%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	49.282.160	1,46%
BI	CETES	280412	AAA(mex)	43.385.950	1,28%
	<b>Chequera Dólares</b>			<b>163.285</b>	<b>0,01%</b>
CHD	40-133	8034712		163.285	0,01%
	<b>Títulos de Credito Extranjeros</b>			<b>43.076.207</b>	<b>1,28%</b>
JE	AMX	0129	AAA (mex)	43.076.207	1,28%
	<b>Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial</b>			<b>8.275.419</b>	<b>0,25%</b>
93	AMX	04626	F1+ (mex)	8.275.419	0,25%
	<b>Udibonos</b>			<b>157.757.991</b>	<b>4,67%</b>
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	103.825.627	3,07%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	53.932.364	1,60%
	<b>Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal</b>			<b>81.594.472</b>	<b>2,42%</b>
95	CFE	20-2	AAA (mex)	81.594.472	2,42%
	<b>Reportos</b>			<b>659.779.779</b>	<b>19,53%</b>
IM	BPAG28	290503	AAA(mex)	611.326.429	18,09%
IQ	BPAG91	310515	AAA(mex)	48.453.351	1,43%

<b>TOTAL CARTERA</b>	<b>3.378.994.710</b>	<b>100,00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>	<b>3.373.968.838</b>	

**Cartera al:** 29/05/2026

---

**Límite Máximo de VaR:** 0,830 % **Var Promedio:** 0,144 %

**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."

---