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			**525,840,835**	**15.32%**
M	BONOS	280302	AAA(mex)	320,147,709	9.33%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	205,693,126	5.99%
	Certificados Bursátiles Corporativos			**524,927,796**	**15.30%**
91	LALA	18	AA (mex)	103,578,047	3.02%
91	GAP	24-2L	mxAAA	89,998,814	2.62%
91	KOF	26	mxAAA	70,334,165	2.05%
91	BIMBO	26	AAA (mex)	60,291,999	1.76%
91	ACBE	26-2	AAA (mex)	60,074,794	1.75%
91	VWLEASE	24-2	mxAAA	53,185,864	1.55%
91	TPLAYCB	24	HR AA-	44,907,291	1.31%
91	ELEKTRA	23-2L	HR AA	42,556,823	1.24%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			**1,375,696,247**	**40.08%**
BI	CETES	260528	AAA(mex)	550,634,068	16.04%
BI	CETES	270902	AAA(mex)	543,348,416	15.83%
BI	CETES	261210	AAA(mex)	135,538,728	3.95%
BI	CETES	260625	AAA(mex)	97,792,930	2.85%
BI	CETES	260820	AAA(mex)	48,382,105	1.41%
	Chequera Dólares			**162,224**	**0.01%**
CHD	40-133	8034712		162,224	0.01%
	Títulos de Credito Extranjeros			**42,660,543**	**1.24%**
JE	AMX	0129	AAA (mex)	42,660,543	1.24%
	Udibonos			**155,290,595**	**4.53%**
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	101,509,113	2.96%
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	53,781,483	1.57%
	Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal			**83,343,478**	**2.43%**
95	CFE	20-2	AAA (mex)	83,343,478	2.43%
	Reportos			**724,190,852**	**21.10%**
LF	BONDESF	300725	AAA(mex)	724,190,852	21.10%

TOTAL CARTERA	**3,432,112,570**	**100.00%**
ACTIVO NETO	**3,568,399,297**	

Cartera al: **27/02/2026**

Límite Máximo de VaR: **0.830 %** **Var Promedio:** **0.072 %**

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."