



MULTISI MULTISI, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 27 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDEF	251002	mxAAA	500,000	50,163,675.00	2.57
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				453,462	45,310,434.80	2.32
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	787,400	79,216,569.91	4.05
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BSMX	23-3	AAA.mx	500,000	50,407,140.50	2.58
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				550,000	55,100,192.45	2.82
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BACMEXT	23-3X	AAA.mx	500,000	50,460,050.50	2.58
CD	BANOB	23-2	AAA.mx	500,000	50,338,480.00	2.58
CD	NAFR	23-2S	mxAAA	500,000	50,328,416.50	2.58
CD	BACMEXT	22X	AAA.mx	450,000	45,133,136.55	2.31
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	HSBCMX	24006	mxA-1+	700,000	70,257,917.80	3.60
F	BINVEX	24002	mxA-1+	550,000	55,019,511.80	2.82
F	BBASE	24009	mxA-2	500,000	50,349,417.50	2.58
F	BINVEX	24019	mxA-1+	500,000	50,336,401.00	2.58
F	BACTINV	23009	HR1	500,000	50,287,181.00	2.57
F	BBASE	24014	mxA-2	500,000	50,269,113.00	2.57
F	BINVEX	24005	mxA-1+	500,000	50,223,500.50	2.57
F	BINVEX	24023	mxA-1+	500,000	50,160,011.00	2.57
F	SABADEL	23013	HR1	500,000	50,142,686.50	2.57
F	BBASE	24012	mxA-2	500,000	50,142,018.00	2.57
F	SABADEL	24001	HR1	500,000	50,016,694.00	2.56
F	SABADEL	24007	HR1	500,000	50,014,072.50	2.56
F	SABADEL	24003	HR1	500,000	50,013,705.50	2.56
F	SABADEL	24008	HR1	500,000	50,012,793.00	2.56
F	BBASE	23026	mxA-2	400,000	40,102,343.20	2.05
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	240711	mxAAA	7,000,000	69,723,437.00	3.57
BI	CETES	241003	mxAAA	6,000,000	58,251,600.00	2.98
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928701		274,703,338	276,973,810.97	14.18
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,648,754,310.48	84.38
REPORTO						
LF	BONDEF	280127	mxAAA	2,562,039	254,734,748.09	13.04
TOTAL REPORTO					254,734,748.09	13.04
OTROS VALORES				501,319	50,421,566.88	2.58
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,953,910,625.45	100.00

	CATEGORÍA	
	IDCP	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAA/1 HR	0.010%	0.040%

Valor en riesgo por simulación histórica con horizonte temporal de 1 día, con 500 observaciones al 95% de nivel de confianza.