



**MULTIAR MULTIFONDO DE ALTO RENDIMIENTO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 2022**

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|--|---------|---------|-----------------------|---------------|-----------------------|--------------------------|
| DISPONIBILIDADES | | | | | | |
| DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN | | | | | | |
| CHM | SABADEL | 2931601 | | 29,854,241 | 30,030,632.01 | 5.25 |
| TOTAL DISPONIBILIDADES | | | | | 30,030,632.01 | 5.25 |
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | | |
| INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | | |
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | | |
| IQ | BPAG91 | 250102 | mxAAA | 120,000 | 12,075,794.64 | 2.11 |
| LD | BONDESD | 230629 | mxAAA | 200,000 | 20,082,562.20 | 3.51 |
| LD | BONDESD | 251211 | mxAAA | 290,000 | 28,976,260.60 | 5.07 |
| M | BONOS | 240905 | mxAAA | 200,000 | 19,925,513.60 | 3.49 |
| M | BONOS | 241205 | mxAAA | 400,000 | 42,761,516.00 | 7.48 |
| M | BONOS | 290531 | mxAAA | 400,000 | 41,224,616.00 | 7.21 |
| S | UDIBONO | 311127 | mxAAA | 64,230 | 43,146,449.06 | 7.55 |
| S | UDIBONO | 351122 | mxAAA | 80,506 | 63,376,017.37 | 11.08 |
| TÍTULOS BANCARIOS | | | | | | |
| CD | BACMEXT | 22X | AAA.mx | 350,000 | 35,054,861.80 | 6.13 |
| F | BBASE | 22020 | mxA-2 | 200,000 | 20,081,281.60 | 3.51 |
| 94 | BACOMER | 19 | AAA.mx | 102,340 | 10,259,090.29 | 1.79 |
| 94 | BACOMER | 20-2 | AAA.mx | 110,000 | 11,081,461.49 | 1.94 |
| 94 | BSMX | 19-2 | AAA.mx | 325,045 | 32,939,984.56 | 5.76 |
| PAPEL PRIVADO | | | | | | |
| 91 | AGUA | 17-2X | mxAA- | 196,480 | 19,259,929.60 | 3.37 |
| 91 | CIRCLEK | 18 | A-(mex) | 152,000 | 15,265,187.02 | 2.67 |
| 91 | FUNO | 18 | AAA(mex) | 107,879 | 10,847,674.14 | 1.90 |
| 91 | GAP | 20 | mxAAA | 140,000 | 14,069,110.02 | 2.46 |
| 91 | GEOCB | 11-2 | | 180,000 | 851,955.48 | 0.15 |
| 91 | GPH | 19 | AAA(mex) | 200,000 | 19,975,773.20 | 3.49 |
| 91 | VASCONI | 19 | A-(mex) | 200,000 | 20,010,094.60 | 3.50 |
| TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | 481,265,133.27 | 84.17 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 481,265,133.27 | 84.17 |
| OPERACIONES DE REPORTE | | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | | |
| IQ | BPAG91 | 260507 | mxAAA | 604,831 | 60,449,075.92 | 10.57 |
| TOTAL OPERACIONES DE REPORTE | | | | | 60,449,075.92 | 10.57 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 571,744,841.20 | 100.00 |

**CATEGORÍA
LARGO PLAZO**

CALIFICACIÓN
AA/3 HR

VaR Promedio
0.166%

Limite de VaR
0.430%

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

LIC. FANNY LORENA RODRIGUEZ GUTIERREZ