MULTISI MULTISI, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2020

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHM	SABADEL	2928701		203,401,552	204,186,868.00	9.09
TOTAL DISPONIBILIDADES					**204,186,868.00**	**9.09**
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IM	BPAG28	210211	mxAAA	500,000	50,044,473.00	2.23
IM	BPAG28	210513	mxAAA	500,000	50,158,535.50	2.23
IM	BPAG28	211111	mxAAA	500,000	50,046,377.00	2.23
IM	BPAG28	221110	mxAAA	500,000	49,961,806.50	2.22
IQ	BPAG91	210422	mxAAA	500,000	50,499,231.00	2.25
LD	BONDESD	201126	mxAAA	500,000	50,170,805.50	2.23
LD	BONDESD	201224	mxAAA	317,071	31,812,469.35	1.42
LD	BONDESD	210121	mxAAA	353,975	35,513,170.53	1.58
LD	BONDESD	210325	mxAAA	500,000	50,118,089.50	2.23
LD	BONDESD	210520	mxAAA	500,000	50,111,837.00	2.23
LD	BONDESD	210527	mxAAA	550,000	55,072,494.95	2.45
LD	BONDESD	210722	mxAAA	500,000	50,060,425.00	2.23
LD	BONDESD	210819	mxAAA	500,000	50,052,973.00	2.23
LD	BONDESD	210915	mxAAA	500,000	50,052,864.50	2.23
LD	BONDESD	211118	mxAAA	500,000	49,992,974.00	2.23
LD	BONDESD	220113	mxAAA	500,000	49,986,514.50	2.23
LD	BONDESD	220203	mxAAA	500,000	50,026,589.00	2.23
LD	BONDESD	220317	mxAAA	499,512	50,058,649.53	2.23
LD	BONDESD	220428	mxAAA	500,000	50,009,027.50	2.23
LD	BONDESD	220714	mxAAA	400,000	40,035,704.00	1.78
LD	BONDESD	220721	mxAAA	500,000	50,002,583.50	2.23
LD	BONDESD	220908	mxAAA	500,000	50,033,803.00	2.23
LD	BONDESD	221013	mxAAA	500,000	49,970,215.50	2.22
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BANSAN	20002	MX-1	400,000	40,466,138.80	1.80
94	BANORTE	18	mxAAA	500,000	50,209,568.50	2.24
94	BSMX	18	Aaa.mx	260,000	25,991,674.80	1.16
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					**1,230,458,994.96**	**54.78**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**1,230,458,994.96**	**54.78**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	230511	mxAAA	5,503,654	550,064,909.94	24.49
LD	BONDESD	250220	mxAAA	2,621,124	261,283,765.38	11.63
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**811,348,675.32**	**36.12**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**2,245,994,538.28**	**100.00**

CATEGORÍA	CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
CORTO PLAZO	AAAf/S2(mex)	0.001%	0.040%

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