



**+CIGUB CI GUBERNAMENTAL, S.A DE C.V. FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 18 FEBRERO, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
LD	BONDESD	210722	mxAAA	2,000,000	200,277,478.00	5.97
LD	BONDESD	211118	mxAAA	3,000,000	300,048,909.00	8.94
LD	BONDESD	220113	mxAAA	1,000,000	99,997,514.00	2.98
LD	BONDESD	220203	mxAAA	1,000,000	100,073,965.00	2.98
LD	BONDESD	220908	mxAAA	3,137,325	313,929,618.13	9.36
LD	BONDESD	230105	mxAAA	500,000	49,957,921.50	1.49
LD	BONDESD	230629	mxAAA	2,500,000	249,331,782.50	7.43
LD	BONDESD	230706	mxAAA	750,000	74,737,835.25	2.23
LD	BONDESD	230831	mxAAA	1,500,000	149,427,954.00	4.45
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,537,782,977.38	45.84
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,537,782,977.38	45.84
OPERACIONES DE REPORTO EN VALORES GUBERNAMENTALES						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	210812	mxAAA	3,990,318	400,045,060.14	11.93
LD	BONDESD	220317	mxAAA	1,377,055	137,558,974.74	4.10
LD	BONDESD	220714	mxAAA	8,590,889	859,709,891.94	25.63
LD	BONDESD	230629	mxAAA	4,206,919	419,463,522.18	12.50
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					1,816,777,449.00	54.16
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					3,354,560,426.38	100.00

CATEGORÍA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/3HR CP

VaR Promedio
0.003%

Límite de VaR
0.030%

En el cálculo del VaR se emplea el método de simulación histórica con un nivel de confianza de 95%, así mismo se toma una muestra de 252 días para su cálculo y un horizonte de confianza de 1 día.