



**+CIUSD CI INSTITUCIONAL, 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
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	CIBANCO	0593072		176,717	3,592,649.90	0.75
CHD	NAFIN	3756001		3,100,000	63,028,689.55	13.22
CHD	NAFIN	3756002		3,400,959	69,145,235.73	14.51
CHD	NAFIN	3756003		3,401,104	69,146,291.83	14.51
CHD	NAFIN	3756201		2,500,000	50,825,508.25	10.66
TOTAL DISPONIBILIDADES					255,738,375.26	53.65
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	SHV	*	ALTA	36,613	82,264,709.89	17.26
1ISP	SHY	*	ALTA	77,902	136,772,447.92	28.69
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					219,037,157.81	45.95
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					219,037,157.81	45.95
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDES	230629	mxAAA	18,888	1,883,284.90	0.40
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,883,284.90	0.40
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					476,658,817.97	100.00

CATEGORÍA
CORTO PLAZO EN MONEDA EXTRANJERA

CALIFICACIÓN
AAA/2HR CP

VaR Promedio
1.595%

Límite de VaR
3.000%

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.