



**+CIPLUS CI RENDIMIENTO, 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 INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
00	CASITA	*	NULA	3,153	0.00	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	220210	mxAAA	900,000	8,652,609.00	13.54
LD	BONDESD	220113	mxAAA	50,000	4,999,875.70	7.82
LD	BONDESD	230831	mxAAA	25,000	2,490,465.90	3.90
PAPEL PRIVADO						
91	ELEKTRA	18	HR AA+	40,000	4,006,059.72	6.27
91	GAP	16	mxAAA	40,000	4,005,495.80	6.27
93	FORD	00521	MX-1	30,000	2,992,661.70	4.68
93	GMFIN	01021	mxA-1+	30,000	3,003,429.48	4.70
93	VWLEASE	01021	mxA-1+	9,478	946,290.48	1.48
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					31,096,887.78	48.65
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					31,096,887.78	48.65
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	210812	mxAAA	327,437	32,826,845.97	51.35
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					32,826,845.97	51.35
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					63,923,733.75	100.00

**CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO**

CALIFICACIÓN
AAA/3HR CP

VaR Promedio
0.008%

Límite de VaR
0.700%

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.