



**+CIPLUS CI RENDIMIENTO, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CÁRTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2019**

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						
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	100,000	10,126,473.80	5.69
LD	BONDES	220113	mxAAA	100,000	10,032,049.40	5.64
LD	BONDES	230831	mxAAA	50,000	4,995,687.05	2.81
PAPEL PRIVADO						
91	AGUA	17X	mxAA-	73,004	7,306,202.65	4.11
91	DAIMLER	17-2	mxAAA	161,436	8,126,723.11	4.57
91	GAP	16	mxAAA	40,000	4,034,025.12	2.27
91	LALA	18-3	AA(mex)	90,000	9,044,581.05	5.08
91	NRF	17	mxAAA	26,000	2,602,300.48	1.46
93	AEROMEX	00219	HR2	75,533	7,598,695.86	4.27
93	AEROMEX	00819	HR2	85,000	8,502,279.62	4.78
93	ELEKTRA	00118	F1(mex)	30,000	3,021,058.41	1.70
93	LAB	00319	HR1	17,677	1,768,153.87	0.99
93	VASCONI	00119	F2(mex)	85,000	8,548,165.42	4.80
93	VIVA	00319	HR3	50,000	5,018,941.55	2.82
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					90,725,337.39	50.98
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					90,725,337.39	50.98
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDES	210520	mxAAA	871,831	87,254,934.92	49.03
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					87,254,934.92	49.03
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					177,980,272.31	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/3HR

VaR Promedio
0.001%

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.

Juan Sebastián Musí Amione

Los valores antes descritos están depositados en el S.D. Ineval Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V.