

**Citi Pure Estimates Momentum US Long-Short TR Index
1/31/2020**

Ticker	Weights
HCN UN	2.50%
SLG UN	2.36%
HCP UN	2.21%
HRB UN	2.04%
WY UN	2.01%
CCL UN	1.93%
SBAC UW	1.92%
WDC UW	1.91%
NWSA UW	1.84%
MOS UN	1.72%
LLY UN	1.59%
SNPS UW	1.45%
QCOM UW	1.44%
STT UN	1.31%
DVN UN	1.28%
LNC UN	1.27%
MPC UN	1.16%
NOV UN	1.13%
VLO UN	1.07%
NKE UN	1.04%
XEC UN	1.01%
HES UN	0.96%
APA UN	0.95%
NBL UN	0.91%
CTAS UW	0.88%
FCX UN	0.88%
FOXA UW	0.87%
LYV UN	0.86%
SYMC UW	0.83%
MU UW	0.80%
AMD UW	0.80%
O UN	0.79%
CHTR UW	0.79%
EOG UN	0.79%
HII UN	0.78%
SPG UN	0.76%
ADSK UW	0.75%
DAL UN	0.74%
NFLX UW	0.73%
IRM UN	0.72%
ROL UN	0.70%
CCI UN	0.70%
BLL UN	0.69%

SRE UN	0.68%
GM UN	0.67%
BLK UN	0.66%
GE UN	0.65%
PH UN	0.65%
CTL UN	0.62%
UA/C UN	0.61%
VRTX UW	0.59%
DOW UN	0.59%
EXPE UW	0.58%
AMGN UW	0.58%
WRK UN	0.57%
AZO UN	0.56%
AES UN	0.55%
TYC UN	0.55%
CXO UN	0.55%
PNR UN	0.55%
LEN UN	0.54%
IVZ UN	0.54%
VMC UN	0.53%
CTVA UN	0.50%
COTY UN	0.49%
EMR UN	0.49%
TRV UN	0.48%
BHI UN	0.48%
CMG UN	0.47%
JEC UN	0.47%
CAG UN	0.45%
DG UN	0.45%
QRVO UW	0.44%
NOC UN	0.44%
BK UN	0.43%
ADM UN	0.42%
NLSN UN	0.42%
MET UN	0.41%
Q UN	0.41%
EXR UN	0.41%
FRT UN	0.40%
ADBE UW	0.39%
CERN UW	0.38%
IR UN	0.37%
NTRS UW	0.37%
VRSK UW	0.36%
MGM UN	0.36%
KSU UN	0.35%
ROP UN	0.34%
TSN UN	0.34%

PBCT UN	0.34%
AA UN	0.34%
AAP UN	0.34%
AMT UN	0.33%
WM UN	0.33%
HOG UN	0.32%
PPG UN	0.31%
ATO UN	0.31%
RTN UN	0.31%
UAL UN	0.30%
MLM UN	0.30%
JKHY UN	0.29%
BBY UN	0.29%
GWW UN	0.29%
JNPR UN	0.29%
LRCX UN	0.29%
ZION UN	0.29%
FTV UN	0.28%
BAC UN	0.28%
ED UN	0.28%
REGN UN	0.28%
KEY UN	0.27%
FB UN	0.27%
XOM UN	0.27%
WLP UN	0.27%
BEN UN	0.27%
UTX UN	0.26%
SNA UN	0.26%
XRAY UN	0.26%
KMI UN	0.26%
FBHS UN	0.25%
NI UN	0.25%
ECL UN	0.25%
HAS UN	0.25%
GS UN	0.25%
REG UN	0.24%
CHD UN	0.24%
HRS UN	0.24%
ACN UN	0.23%
KR UN	0.23%
MTB UN	0.23%
KEYS UN	0.23%
HON UN	0.22%
RSG UN	0.22%
PWR UN	0.22%
SEE UN	0.22%
SYF UN	0.22%

ALGN UW	0.21%
CPB UN	0.21%
SWKS UW	0.21%
DOV UN	0.20%
VAR UN	0.20%
OKE UN	0.20%
TROW UW	0.20%
COH UN	0.20%
MRO UN	0.19%
VFC UN	0.19%
DTE UN	0.19%
BDX UN	0.19%
YUM UN	0.19%
FLS UN	0.19%
NWS UW	0.19%
ABC UN	0.18%
WSH UW	0.18%
PX UN	0.18%
ACE UN	0.18%
FTI UN	0.18%
XEL UW	0.18%
JNJ UN	0.18%
AAPL UW	0.18%
STX UW	0.17%
PEG UN	0.17%
MYL UW	0.16%
MDLZ UW	0.16%
PSA UN	0.16%
AEE UN	0.16%
NVDA UW	0.16%
AMP UN	0.15%
APD UN	0.15%
DIS UN	0.15%
A UN	0.14%
WAB UN	0.14%
RF UN	0.13%
ROK UN	0.13%
EXPD UW	0.13%
DUK UN	0.13%
RL UN	0.13%
WEC UN	0.13%
PNW UN	0.12%
GD UN	0.12%
MCD UN	0.12%
ESS UN	0.12%
CMS UN	0.12%
WAT UN	0.12%

FIS UN	0.11%
MKTX UW	0.11%
SYK UN	0.11%
EXC UN	0.11%
SLB UN	0.10%
MCK UN	0.10%
SWK UN	0.10%
RE UN	0.10%
MAS UN	0.10%
SBUX UW	0.09%
TSCO UW	0.09%
CI UN	0.09%
HPE UN	0.09%
MXIM UW	0.09%
WR UN	0.09%
AIG UN	0.09%
SJM UN	0.09%
GPN UN	0.08%
FLIR UW	0.08%
PCLN UW	0.08%
AON UN	0.08%
WRB UN	0.08%
BBT UN	0.08%
LOW UN	0.08%
ALL UN	0.08%
TFX UN	0.08%
PM UN	0.08%
RHI UN	0.08%
MRK UN	0.07%
FITB UW	0.07%
COP UN	0.07%
INTU UW	0.06%
MMM UN	0.06%
AME UN	0.06%
ADP UW	0.06%
PAYX UW	0.06%
SHW UN	0.06%
ORCL UN	0.06%
AMCR UN	0.05%
AIZ UN	0.05%
CME UW	0.05%
GIS UN	0.05%
V UN	0.05%
RMD UN	0.05%
FOX UW	0.04%
WBA UW	0.04%
MMC UN	0.04%

PNC UN	0.04%
LTD UN	0.04%
DLPH UN	0.04%
PKI UN	0.04%
CSCO UW	0.04%
NOW UN	0.04%
RCL UN	0.04%
MDT UN	0.04%
AVB UN	0.03%
GOOG UW	0.03%
L UN	0.03%
PRGO UN	0.03%
ADS UN	0.03%
UHS UN	0.03%
GOOGL UW	0.03%
EIX UN	0.03%
CLX UN	0.02%
MO UN	0.02%
UPS UN	0.02%
NU UN	0.02%
MCHP UW	0.02%
BF/B UN	0.02%
ATVI UW	0.02%
CBS UN	0.02%
AEP UN	0.02%
MS UN	0.01%
FISV UW	0.01%
MAA UN	0.01%
AVY UN	0.01%
TGT UN	0.00%
HSY UN	0.00%
IEX UN	0.00%
BAX UN	0.00%
ALLE UN	0.00%
PPL UN	0.00%
D UN	-0.01%
LEG UN	-0.01%
GPC UN	-0.01%
FLT UN	-0.01%
CVS UN	-0.01%
IBM UN	-0.01%
EMN UN	-0.01%
STZ UN	-0.01%
AMAT UW	-0.01%
CPRT UW	-0.02%
DLTR UW	-0.02%
KMB UN	-0.02%

BSX UN	-0.02%
AXP UN	-0.02%
GLW UN	-0.03%
CL UN	-0.03%
PYPL UW	-0.03%
JBHT UW	-0.03%
EQIX UW	-0.03%
BR UN	-0.03%
XLNX UW	-0.03%
CAH UN	-0.04%
GILD UW	-0.04%
CVX UN	-0.04%
VZ UN	-0.04%
MRKT UW	-0.04%
WMT UN	-0.04%
CE UN	-0.04%
MNST UW	-0.05%
WYNN UW	-0.05%
KO UN	-0.05%
UNH UN	-0.05%
RJF UN	-0.05%
ABT UN	-0.05%
HCA UN	-0.05%
UNM UN	-0.05%
OMC UN	-0.05%
PEP UN	-0.05%
NCLH UW	-0.05%
MSCI UN	-0.06%
LKQ UW	-0.06%
EW UN	-0.06%
PG UN	-0.06%
AMZN UW	-0.06%
FRC UN	-0.06%
EL UN	-0.06%
DGX UN	-0.06%
ALK UN	-0.06%
ALXN UW	-0.06%
MHK UN	-0.06%
BRK/B UN	-0.07%
ITW UN	-0.07%
TDG UN	-0.07%
DXC UN	-0.07%
LNT UN	-0.07%
GRMN UW	-0.07%
DISCK UW	-0.07%
LMT UN	-0.07%
NEE UN	-0.08%

HSIC UW	-0.08%
WHR UN	-0.08%
JPM UN	-0.08%
IDXX UW	-0.08%
PFE UN	-0.08%
LW UN	-0.09%
IPG UN	-0.09%
DVA UN	-0.09%
FAST UW	-0.09%
CINF UW	-0.09%
TMUS UW	-0.10%
STE UN	-0.10%
IT UN	-0.10%
LH UN	-0.10%
KIM UN	-0.11%
ABBV UN	-0.12%
ACT UN	-0.12%
ICE UN	-0.12%
PRU UN	-0.12%
CTSH UW	-0.12%
TJX UN	-0.12%
WFC UN	-0.12%
NTAP UW	-0.13%
FTNT UW	-0.13%
ORLY UW	-0.13%
TEL UN	-0.14%
MTD UN	-0.14%
KLAC UW	-0.14%
LDOS UN	-0.15%
TMO UN	-0.15%
MHFI UN	-0.15%
NDAQ UW	-0.15%
UNP UN	-0.15%
HOLX UW	-0.15%
ZMH UN	-0.15%
FANG UW	-0.16%
ISRG UW	-0.16%
HUM UN	-0.16%
AKAM UW	-0.17%
GPS UN	-0.17%
ILMN UW	-0.17%
COST UW	-0.17%
SY Y UN	-0.17%
FFIV UW	-0.17%
KORS UN	-0.17%
COF UN	-0.18%
EA UW	-0.19%

BWA UN	-0.19%
ETR UN	-0.19%
PHM UN	-0.20%
AJG UN	-0.21%
INCY UW	-0.21%
DRI UN	-0.21%
AVGO UW	-0.22%
LUV UN	-0.22%
TMK UN	-0.22%
WU UN	-0.23%
K UN	-0.23%
ZTS UN	-0.23%
XYL UN	-0.23%
T UN	-0.23%
APH UN	-0.23%
ROST UW	-0.23%
ABMD UW	-0.24%
PVH UN	-0.24%
EBAY UW	-0.24%
NSC UN	-0.25%
VRSN UW	-0.25%
CHRW UW	-0.26%
AWK UN	-0.26%
MSI UN	-0.27%
HPQ UN	-0.28%
NVR UN	-0.30%
DHI UN	-0.31%
HLT UN	-0.31%
MSFT UW	-0.31%
INTC UW	-0.32%
SO UN	-0.34%
CDNS UW	-0.34%
HIG UN	-0.34%
FMC UN	-0.34%
CFG UN	-0.35%
CRM UN	-0.36%
AOS UN	-0.36%
USB UN	-0.36%
CBG UN	-0.37%
FE UN	-0.38%
ETFC UW	-0.38%
ULTA UW	-0.39%
KSS UN	-0.39%
KHC UW	-0.39%
BIIB UW	-0.40%
ODFL UW	-0.40%
LYB UN	-0.41%

MCO UN	-0.41%
MKC UN	-0.42%
URI UN	-0.42%
HBAN UW	-0.42%
EFX UN	-0.42%
AFL UN	-0.46%
PXD UN	-0.47%
SCHW UN	-0.47%
DFS UN	-0.47%
MAR UW	-0.48%
HBI UN	-0.48%
PSX UN	-0.49%
CNC UN	-0.49%
LVS UN	-0.52%
PFG UN	-0.55%
ADI UW	-0.57%
CAT UN	-0.57%
CBOE UW	-0.57%
TXN UW	-0.60%
ZBRA UW	-0.61%
CMA UN	-0.65%
NWL UN	-0.65%
IPGP UW	-0.71%
CSX UW	-0.71%
NRG UN	-0.71%
ANET UN	-0.74%
PKG UN	-0.76%
CTXS UW	-0.76%
F UN	-0.77%
TTWO UW	-0.81%
ANSS UW	-0.81%
DHR UN	-0.83%
BMJ UN	-0.85%
COO UN	-0.88%
CDW UW	-0.88%
CMI UN	-0.91%
IP UN	-0.95%
VTR UN	-0.96%
TXT UN	-1.01%
SIVB UW	-1.01%
ETN UN	-1.03%
TAP UN	-1.05%
PCAR UW	-1.12%
CMCSA UW	-1.18%
EQR UN	-1.26%
NUE UN	-1.29%
FDX UN	-1.33%

CNP UN	-1.38%
PGR UN	-1.40%
HST UN	-1.41%
DE UN	-1.42%
VNO UN	-1.46%
NEM UN	-1.48%
BXP UN	-1.49%
DRE UN	-1.51%
HFC UN	-1.58%
KMX UN	-1.60%
HAL UN	-1.60%
CF UN	-1.61%
PLD UN	-1.62%
UDR UN	-1.62%
DISH UW	-1.63%
HD UN	-1.72%
XRX UN	-1.76%
COG UN	-1.79%
AIV UN	-1.80%
BA UN	-1.80%
WMB UN	-1.81%
OXY UN	-1.84%
TIF UN	-1.85%
HP UN	-1.96%
TWTR UN	-2.07%
ARE UN	-2.08%