

Citi Pure Estimates Momentum US Long-Short TR Index
10.31.19

Ticker	Weights
STX UW	1.91%
PWR UN	1.91%
NKE UN	1.68%
CTAS UW	1.63%
AMP UN	1.56%
DVN UN	1.49%
PLD UN	1.44%
MKTX UW	1.41%
STT UN	1.30%
KMX UN	1.28%
BEN UN	1.27%
ICE UN	1.23%
SRE UN	1.22%
BXP UN	1.22%
GE UN	1.22%
BK UN	1.15%
GPN UN	1.12%
NOV UN	1.08%
CBOE UW	1.07%
VAR UN	1.06%
ADM UN	1.06%
WY UN	1.05%
ABBV UN	1.02%
AA UN	1.00%
NDAQ UW	0.97%
HES UN	0.94%
STZ UN	0.93%
VZ UN	0.93%
PNR UN	0.89%
WRK UN	0.88%
WDC UW	0.86%
AMGN UW	0.85%
DISCK UW	0.84%
PRU UN	0.84%
BA UN	0.82%
AES UN	0.80%
APA UN	0.77%
MU UW	0.74%
CI UN	0.74%
DHR UN	0.74%
BMJ UN	0.73%
KLAC UW	0.71%
WHR UN	0.70%

INCY UW	0.69%
DG UN	0.69%
AMCR UN	0.68%
CF UN	0.68%
HPE UN	0.66%
CME UW	0.66%
DOW UN	0.65%
KSS UN	0.65%
DOW UN	0.64%
HOG UN	0.63%
SYF UN	0.62%
WU UN	0.62%
MHFI UN	0.62%
CPRT UW	0.61%
TROW UW	0.60%
HAS UW	0.58%
EIX UN	0.57%
ALK UN	0.57%
IVZ UN	0.56%
EQIX UW	0.56%
EOG UN	0.54%
CINF UW	0.54%
WAB UN	0.53%
BBY UN	0.53%
MKC UN	0.52%
VRSK UW	0.52%
ATVI UW	0.50%
NFLX UW	0.50%
XEC UN	0.50%
HII UN	0.50%
OXY UN	0.48%
VNO UN	0.48%
LRCX UW	0.47%
VTR UN	0.47%
HIG UN	0.46%
FB UW	0.46%
EMN UN	0.46%
PNC UN	0.46%
MGM UN	0.45%
USB UN	0.45%
EXC UN	0.45%
WR UN	0.44%
WBA UW	0.44%
UTX UN	0.44%
ATO UN	0.44%
BRK/B UN	0.43%
NBL UN	0.43%

CHD UN	0.42%
KEYS UN	0.40%
MSCI UN	0.40%
GD UN	0.40%
AMD UW	0.39%
KMI UN	0.39%
KHC UW	0.39%
RTN UN	0.39%
REG UN	0.38%
SNA UN	0.38%
AMZN UW	0.38%
KMB UN	0.38%
FLS UN	0.38%
DAL UN	0.38%
ADSK UW	0.37%
AOS UN	0.37%
SNPS UW	0.37%
JNPR UN	0.36%
TRV UN	0.35%
CHRW UW	0.35%
ROL UN	0.33%
CTVA UN	0.33%
CTXS UW	0.33%
ALL UN	0.32%
VLO UN	0.32%
MMC UN	0.31%
PVH UN	0.31%
URI UN	0.31%
BSX UN	0.30%
ORCL UN	0.30%
UPS UN	0.30%
PM UN	0.30%
FOX UW	0.30%
UA/C UN	0.30%
FOXA UW	0.29%
TGT UN	0.29%
COG UN	0.29%
XYL UN	0.28%
NTAP UW	0.28%
PX UN	0.27%
NOC UN	0.27%
LMT UN	0.27%
PGR UN	0.27%
KSU UN	0.26%
UAL UN	0.26%
TAP UN	0.26%
HRB UN	0.26%

DUK UN	0.26%
PH UN	0.25%
PPL UN	0.24%
JEC UN	0.24%
IRM UN	0.24%
UNP UN	0.23%
CMG UN	0.23%
XEL UW	0.22%
EL UN	0.22%
SLG UN	0.22%
FBHS UN	0.21%
MDT UN	0.21%
L UN	0.21%
CTL UN	0.21%
NVDA UW	0.21%
HPQ UN	0.20%
AZO UN	0.19%
HOLX UW	0.18%
KO UN	0.18%
UDR UN	0.18%
HRS UN	0.18%
NVR UN	0.18%
COTY UN	0.18%
JNJ UN	0.18%
SEE UN	0.17%
FFIV UW	0.17%
EXPD UW	0.17%
IPG UN	0.17%
COF UN	0.17%
CVX UN	0.16%
COH UN	0.16%
GPC UN	0.15%
MO UN	0.15%
SYY UN	0.14%
TDG UN	0.14%
PSA UN	0.14%
ZTS UN	0.13%
BIIB UW	0.13%
FLIR UW	0.13%
DLTR UW	0.13%
XRX UN	0.13%
IT UN	0.12%
TMUS UW	0.12%
COP UN	0.12%
AIZ UN	0.12%
WEC UN	0.12%
AMT UN	0.12%

GOOGL UW	0.12%
NTRS UW	0.11%
MRK UN	0.11%
MHK UN	0.11%
PRGO UN	0.11%
ADBE UW	0.11%
WM UN	0.11%
FAST UW	0.10%
EXR UN	0.10%
ABC UN	0.10%
CBG UN	0.10%
CBS UN	0.09%
VRTX UW	0.09%
KR UN	0.09%
IP UN	0.09%
MCD UN	0.09%
APD UN	0.09%
IEX UN	0.09%
GOOG UW	0.09%
JKHY UW	0.08%
MDLZ UW	0.08%
TRIP UW	0.08%
VFC UN	0.08%
MYL UW	0.08%
EXPE UW	0.07%
APH UN	0.07%
CAH UN	0.07%
DISH UW	0.07%
INTC UW	0.07%
PEG UN	0.07%
ACE UN	0.06%
CNC UN	0.05%
KEY UN	0.05%
LTD UN	0.05%
PSX UN	0.05%
FTNT UW	0.04%
CHTR UW	0.04%
FMC UN	0.04%
CERN UW	0.04%
FTI UN	0.04%
QRVO UW	0.04%
AIG UN	0.04%
BR UN	0.04%
MPC UN	0.04%
CCI UN	0.04%
O UN	0.04%
MSFT UW	0.03%

HCA UN	0.03%
K UN	0.03%
PNW UN	0.02%
ESS UN	0.02%
ALGN UW	0.02%
SYMC UW	0.02%
VMC UN	0.02%
DTE UN	0.02%
FIS UN	0.01%
OKE UN	0.01%
MAR UW	0.01%
DHI UN	0.01%
SBAC UW	0.01%
ECL UN	0.01%
LNC UN	0.00%
ABT UN	0.00%
NWS UW	0.00%
LEG UN	0.00%
MCK UN	0.00%
PCLN UW	0.00%
WCG UN	-0.01%
PPG UN	-0.01%
EA UW	-0.01%
FTV UN	-0.01%
ALXN UW	-0.01%
LKQ UW	-0.01%
LDOS UN	-0.02%
AVY UN	-0.03%
PFE UN	-0.03%
BLK UN	-0.03%
AMG UN	-0.03%
INTU UW	-0.03%
EW UN	-0.03%
IR UN	-0.03%
AEE UN	-0.04%
PHM UN	-0.04%
PAYX UW	-0.04%
DVA UN	-0.05%
MSI UN	-0.05%
HSIC UW	-0.05%
ORLY UW	-0.05%
WMB UN	-0.05%
PYPL UW	-0.05%
AVB UN	-0.05%
BLL UN	-0.05%
ANET UN	-0.05%
GILD UW	-0.05%

NWL UN	-0.06%
HBI UN	-0.06%
CNP UN	-0.07%
ILMN UW	-0.07%
CL UN	-0.08%
LUV UN	-0.08%
BWA UN	-0.08%
CRM UN	-0.08%
CTSH UW	-0.09%
CDNS UW	-0.09%
ETR UN	-0.09%
FLT UN	-0.09%
PKI UN	-0.10%
TJX UN	-0.10%
VIAB UW	-0.10%
QCOM UW	-0.10%
AMAT UW	-0.10%
DOV UN	-0.10%
HFC UN	-0.10%
ACT UN	-0.11%
IBM UN	-0.11%
GIS UN	-0.11%
TTWO UW	-0.11%
HLT UN	-0.11%
A UN	-0.12%
FISV UW	-0.12%
WAT UN	-0.12%
ROST UW	-0.13%
CAT UN	-0.13%
VRSN UW	-0.13%
ISRG UW	-0.13%
TXN UW	-0.14%
PKG UN	-0.14%
HBAN UW	-0.14%
LH UN	-0.14%
GM UN	-0.14%
CAG UN	-0.14%
TYC UN	-0.15%
LNT UN	-0.15%
SHW UN	-0.15%
CSX UW	-0.15%
HSY UN	-0.16%
GRMN UW	-0.16%
MAA UN	-0.16%
LLY UN	-0.16%
MET UN	-0.16%
NRG UN	-0.16%

Q UN	-0.16%
UHS UN	-0.17%
PXD UN	-0.17%
BDX UN	-0.17%
MTD UN	-0.17%
SPG UN	-0.17%
BF/B UN	-0.17%
MLM UN	-0.17%
EFX UN	-0.18%
DGX UN	-0.18%
EBAY UW	-0.19%
WSH UW	-0.19%
DFS UN	-0.19%
HD UN	-0.19%
SJM UN	-0.20%
F UN	-0.20%
ANSS UW	-0.20%
GWW UN	-0.21%
UNH UN	-0.21%
ADI UW	-0.21%
UNM UN	-0.22%
HUM UN	-0.22%
AXP UN	-0.22%
AON UN	-0.22%
AKAM UW	-0.23%
TMO UN	-0.23%
COST UW	-0.23%
XRAY UW	-0.23%
KORS UN	-0.24%
NU UN	-0.24%
AWK UN	-0.25%
LOW UN	-0.25%
ABMD UW	-0.25%
CDW UW	-0.26%
MCO UN	-0.27%
CVS UN	-0.27%
BAX UN	-0.27%
V UN	-0.27%
TSCO UW	-0.28%
CELG UW	-0.28%
ULTA UW	-0.28%
KIM UN	-0.28%
NSC UN	-0.29%
RSG UN	-0.29%
OMC UN	-0.30%
CPB UN	-0.30%
NEM UN	-0.30%

ARE UN	-0.30%
WMT UN	-0.30%
EQR UN	-0.30%
YUM UN	-0.31%
COO UN	-0.31%
SYK UN	-0.33%
PFG UN	-0.33%
PG UN	-0.33%
FE UN	-0.35%
WFC UN	-0.35%
ADP UW	-0.35%
ZMH UN	-0.35%
WLP UN	-0.35%
AAPL UW	-0.35%
IDXX UW	-0.36%
RMD UN	-0.36%
PCAR UW	-0.37%
DLR UN	-0.37%
BAC UN	-0.37%
LYB UN	-0.38%
RF UN	-0.38%
NI UN	-0.38%
ETFC UW	-0.39%
ALLE UN	-0.39%
MXIM UW	-0.39%
ED UN	-0.40%
LW UN	-0.40%
CMI UN	-0.41%
SO UN	-0.41%
DE UN	-0.42%
MNST UW	-0.42%
SCHW UN	-0.44%
AVGO UW	-0.45%
DRE UN	-0.45%
BHI UN	-0.45%
CSCO UW	-0.46%
CE UN	-0.47%
RHI UN	-0.48%
GPS UN	-0.49%
DRI UN	-0.49%
GLW UN	-0.49%
D UN	-0.50%
MS UN	-0.50%
HON UN	-0.50%
AAP UN	-0.50%
CCL UN	-0.51%
ROP UN	-0.52%

IPGP UW	-0.52%
CXO UN	-0.53%
CMCSA UW	-0.54%
ADS UN	-0.55%
MAS UN	-0.56%
STI UN	-0.56%
JBHT UW	-0.56%
NEE UN	-0.56%
AFL UN	-0.57%
RCL UN	-0.59%
CMS UN	-0.60%
NLSN UN	-0.61%
REGN UW	-0.61%
T UN	-0.61%
FANG UW	-0.62%
MTB UN	-0.63%
DXC UN	-0.65%
BBT UN	-0.65%
LEN UN	-0.66%
SWKS UW	-0.67%
JPM UN	-0.69%
HST UN	-0.70%
RL UN	-0.72%
ZION UW	-0.73%
TEL UN	-0.75%
MMM UN	-0.75%
NWSA UW	-0.75%
DLPH UN	-0.77%
AEP UN	-0.77%
TFX UN	-0.78%
TXT UN	-0.80%
GS UN	-0.80%
PEP UN	-0.81%
TSN UN	-0.82%
AJG UN	-0.82%
TMK UN	-0.83%
ETN UN	-0.84%
SBUX UW	-0.85%
NCLH UW	-0.87%
MRO UN	-0.87%
FITB UW	-0.88%
FCX UN	-0.90%
FRT UN	-0.90%
TWTR UN	-0.92%
PBCT UW	-0.92%
RJF UN	-0.92%
AME UN	-0.93%

CMA UN	-0.94%
HCN UN	-0.95%
AIV UN	-0.95%
FRC UN	-0.95%
ITW UN	-0.96%
ROK UN	-0.99%
RE UN	-1.01%
XLNX UW	-1.02%
SLB UN	-1.02%
DIS UN	-1.11%
MOS UN	-1.12%
FDX UN	-1.12%
XOM UN	-1.12%
HCP UN	-1.13%
EMR UN	-1.14%
SWK UN	-1.15%
CLX UN	-1.18%
CFG UN	-1.18%
WYNN UW	-1.19%
MRKT UW	-1.20%
AAL UW	-1.27%
HP UN	-1.37%
NUE UN	-1.38%
HAL UN	-1.40%
SIVB UW	-1.58%
ACN UN	-1.69%