

**FONDEO**

AAAf/S1

**SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA****CORTO PLAZO**

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>				
LD	BONDES	180628	NO APLICA	200,837	4.406%
LD	BONDES	190606	NO APLICA	100,176	2.198%
LD	BONDES	180705	NO APLICA	40,108	0.880%
				<b>341,121</b>	<b>7.483%</b>
	<b>VALORES EN REPORTO</b>				
LD	BONDES	190328	NO APLICA	2,216,977	48.634%
LD	BONDES	220714	NO APLICA	1,451,002	31.831%
LD	BONDES	190808	NO APLICA	549,422	12.053%
				<b>4,217,401</b>	<b>92.517%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>4,558,522</b>	<b>100.000%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>4,555,427</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>228</b>	<b>0.01%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>-</b>	<b>0.00%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>28-feb-18</b>		

Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.