

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 | % |
|---------|----------------------------------|--------|------------------|------------------|-----------------|
| | BONDES D | | | 570,737 | 7.941% |
| LD | BONDES D | 181213 | NO APLICA | 250,567 | 3.486% |
| LD | BONDES D | 181011 | NO APLICA | 119,778 | 1.667% |
| LD | BONDES D | 190328 | NO APLICA | 100,356 | 1.396% |
| LD | BONDES D | 190606 | NO APLICA | 100,036 | 1.392% |
| | Reportos | | | 6,616,669 | 92.059% |
| LD | BONDES D | 200730 | NO APLICA | 2,394,760 | 33.319% |
| LD | BONDES D | 220512 | NO APLICA | 2,001,338 | 27.845% |
| LD | BONDES D | 201126 | NO APLICA | 1,620,169 | 22.542% |
| LD | BONDES D | 210325 | NO APLICA | 600,401 | 8.354% |
| | TOTAL CARTERA | | | 7,187,406 | 100.000% |
| | ACTIVO NETO | | | 7,180,960 | |
| | VAR ESTABLECIDO \$ | | | 359 | 0.005% |
| | VAR OBSERVADO PROMEDIO \$ | | | - | 0.000% |
| | Cartera al: | | 28-sep-18 | | |

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