

**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	181011	NO APLICA	119,582	1.748%
LD	BONDES	190606	NO APLICA	100,443	1.468%
LD	BONDES	180705	NO APLICA	40,212	0.588%
				<b>260,237</b>	<b>3.805%</b>
<b>VALORES EN REPORTO</b>					
LD	BONDES	210722	NO APLICA	2,777,909	40.612%
LD	BONDES	220317	NO APLICA	2,001,317	29.258%
LD	BONDES	210520	NO APLICA	1,116,810	16.327%
LD	BONDES	210722	NO APLICA	312,557	4.569%
LD	BONDES	230105	NO APLICA	287,838	4.208%
LD	BONDES	210915	NO APLICA	83,480	1.220%
				<b>6,579,911</b>	<b>96.195%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>6,840,148</b>	<b>100.000%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>6,744,874</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>337</b>	<b>0.01%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>-</b>	<b>0.00%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>29-jun-18</b>		

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