

**FONDEO**

AAAf/S1

**SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA**

**CORTO PLAZO**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>BONDES D</b>			<b>570,748,955</b>	<b>8.613%</b>
LD	BONDESD	181213	NO APLICA	251,154,548	3.790%
LD	BONDESD	181011	NO APLICA	119,335,967	1.801%
LD	BONDESD	190606	NO APLICA	100,272,642	1.513%
LD	BONDESD	190328	NO APLICA	99,985,799	1.509%
	<b>Reportos</b>			<b>6,056,115,594</b>	<b>91.387%</b>
LD	BONDESD	220714	NO APLICA	2,000,431,643	30.187%
M	BONOS	241205	NO APLICA	1,805,066,297	27.239%
IQ	BPAG91	210422	NO APLICA	1,448,071,502	21.852%
LD	BONDESD	210121	NO APLICA	350,075,526	5.283%
IM	BPAG28	200220	NO APLICA	250,053,890	3.773%
M	BONOS	310529	NO APLICA	202,416,737	3.054%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>6,626,864,549</b>	<b>100.000%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>6,622,914,359</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>331,146</b>	<b>0.005%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>-</b>	<b>0.000%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>13-sep-18</b>		

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