

**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>340,766,173</b>	<b>5.366%</b>
LD	BONDES D	180628	NO APLICA	200,629,842	3.159%
LD	BONDES D	190606	NO APLICA	100,070,017	1.576%
LD	BONDES D	180705	NO APLICA	40,066,314	0.631%
	<b>Reportos</b>			<b>6,009,456,622</b>	<b>94.634%</b>
IS	BPA182	230907	NO APLICA	3,408,910,497	53.682%
LD	BONDES D	200402	NO APLICA	1,473,218,640	23.199%
LD	BONDES D	180628	NO APLICA	527,201,328	8.302%
IM	BPAG28	191121	NO APLICA	313,411,861	4.935%
LD	BONDES D	220317	NO APLICA	286,714,296	4.515%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>6,350,222,796</b>	<b>100.000%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>6,347,953,687</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>317,398</b>	<b>0.005%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>-</b>	<b>0.000%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>14-jun-18</b>		

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