

PORTAFOLIO DE INVERSIONES

POR TIPO DE INVERSIÓN

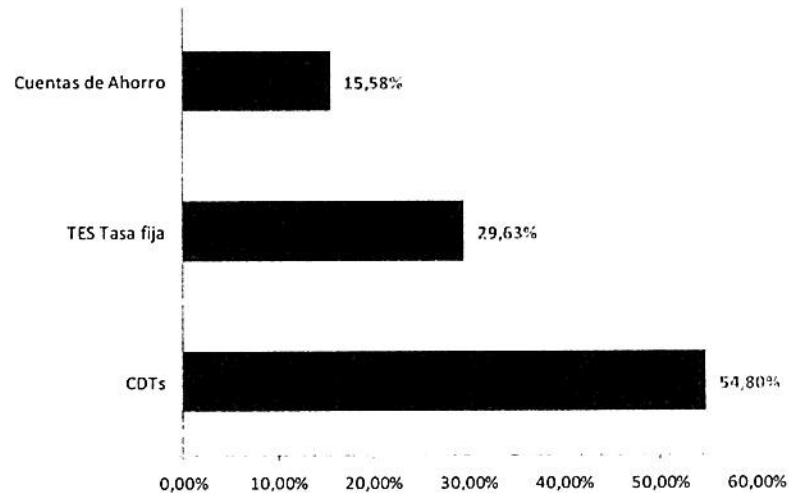
Fiduciaria Bogotá 

PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN

PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN (valores en pesos)

INVERSIÓN	31-dic-17	PARTICIPACIÓN
CDTs	13.961.177.500	54,80%
TES Tasa fija	7.547.639.000	29,63%
Cuentas de Ahorro	3.968.127.464	15,58%
TOTAL	25.476.943.964,37	100,00%

Valores en millones



POR PLAZO

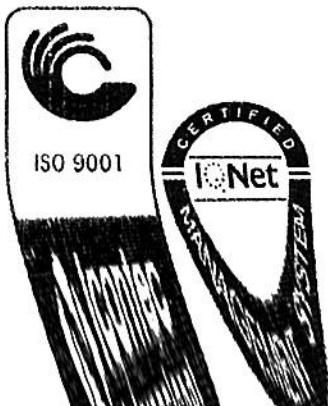
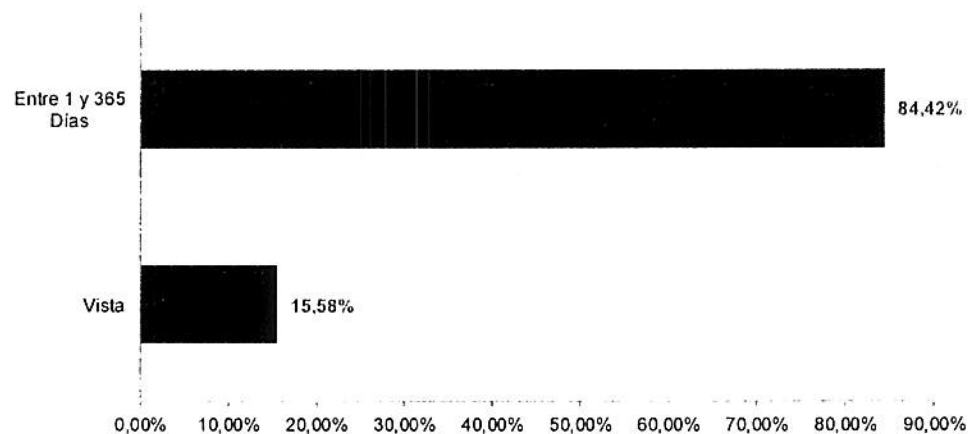
Fiduciaria Bogotá 

PORTAFOLIO POR PLAZO

PORTAFOLIO POR PLAZO (valores en pesos)

INVERSIÓN	31-dic-17	PARTICIPACIÓN
Vista	3.968.127.464,37	15,58%
Entre 1 y 365 Días	21.508.816.500,00	84,42%
TOTAL	25.476.943.964,37	100,00%

Valores en millones



Calle 67 No. 7 -37 Piso 3 • Bogotá • Colombia • (571) 3485400 • www.fidubogota.com

POR EMISOR

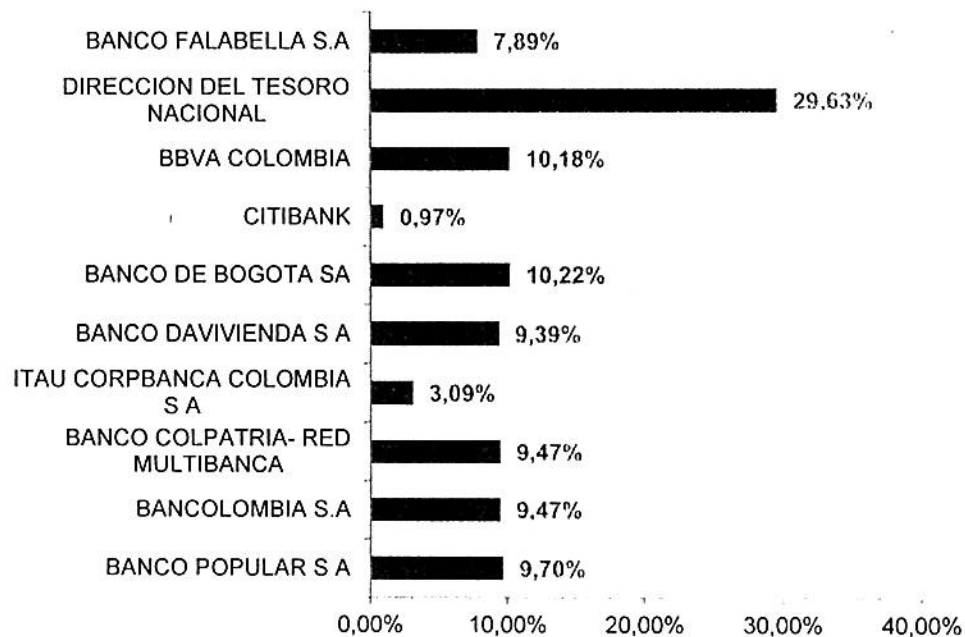
Fiduciaria Bogotá 

PORTAFOLIO POR EMISOR

PORTAFOLIO POR EMISOR
(valores en pesos)

INVERSIÓN	31-dic-17	PARTICIPACIÓN
BANCO POPULAR S A	2.471.732.583,82	9,70%
BANCOLOMBIA S.A	2.412.271.500,00	9,47%
BANCO COLPATRIA- RED MULTIBANCA	2.412.956.000,00	9,47%
ITAU CORPBANCA COLOMBIA S A	787.546.000,00	3,09%
BANCO DAVIVIENDA S A	2.392.971.000,00	9,39%
BANCO DE BOGOTA SA	2.602.873.544,29	10,22%
CITIBANK	246.585.691,33	0,97%
BBVA COLOMBIA	2.593.368.644,93	10,18%
DIRECCION DEL TESORO NACIONAL	7.547.639.000,00	29,63%
BANCO FALABELLA S.A	2.009.000.000,00	7,89%
TOTAL	25.476.943.964,37	100,00%

Valores en millones



TIPO DE TASA



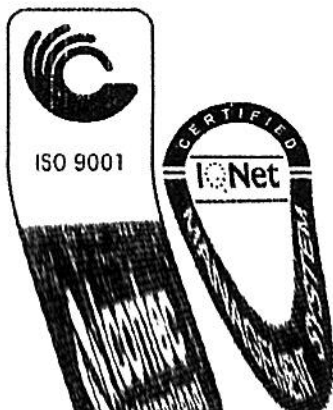
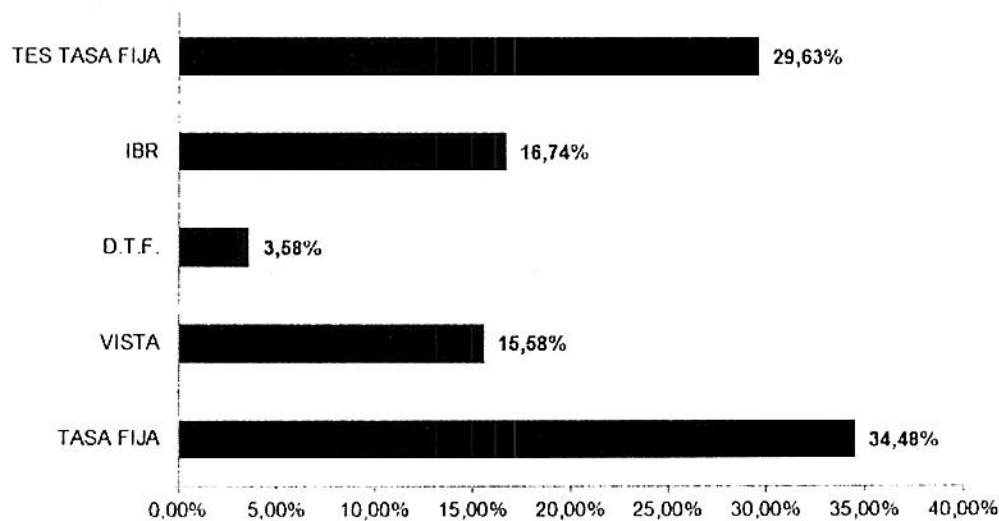
PORTAFOLIO POR TASA

PORTAFOLIO POR TIPO DE TASA

(valores en pesos)

INVERSIÓN	31-dic-17	PARTICIPACIÓN
TASA FIJA	8.784.812.000,00	34,48%
VISTA	3.968.127.464,37	15,58%
D.T.F.	911.318.000,00	3,58%
IBR	4.265.047.500,00	16,74%
TES TASA FIJA	7.547.639.000,00	29,63%
TOTAL	25.476.943.964,37	100,00%

CIFRAS EN MILLONES



Calle 67 No. 7 -37 Piso 3 • Bogotá • Colombia • (571) 3485400 • www.fidubogota.com

RENTABILIDAD

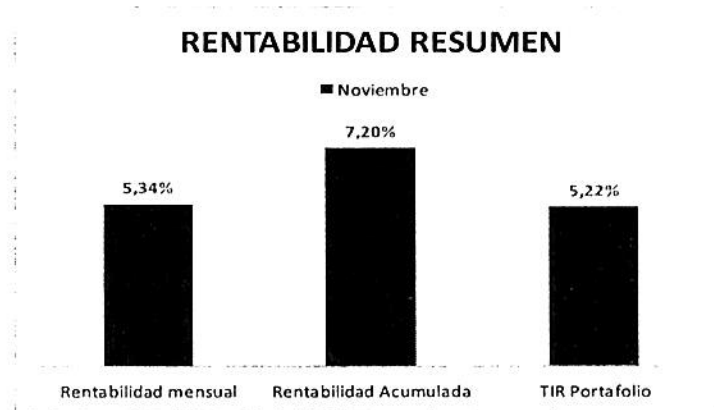
ACUEDUCTO MENSUAL DICIEMBRE 2017

CONCEPTO	FECHA	VALOR
SALDO INICIAL	30/11/2017	16.069.626.521,89
SALDO FINAL	31/12/2017	- 25.476.943.964,37
RENTABILIDAD		5,34%

RENTABILIDAD MENSUAL DICIEMBRE 2017	5,34%
RENTABILIDAD DESDE NOVIEMBRE 2016	7,20%
RENTABILIDAD DESDE INICIO DEL NEGOCIO HASTA NOVIEMBRE DE 2016	8,33%

Fiduciaria Bogotá 

	Rentabilidad mensual	Rentabilidad Acumulada	TIR Portafolio
Noviembre	5,34%	7,20%	5,22%



VENTAS

Fiduciaria Bogotá 

Título	Sec. Via	Emisor	Id. Emisor	Fecha Operación	Valor Operación	Valor Compra	Valor Nominal	Moneda	Fecha Compra
--------	----------	--------	------------	-----------------	-----------------	--------------	---------------	--------	--------------

No hay registros de ventas para este período en la BD

RENDIMIENTOS

Fiduciaria Bogotá 

Fecha	Portafolio	Tipo Operación	Valor	Contraparte	Emisión	Nominal	Vencido	Bin
4/12/2017	P48176 ACUEDUCTO BOG	Cobre Rdlos. Capital	1.394.000,00	BANCOLOMBIA S.A	CDI	250.000.000,00	2/02/2018	COB07CD01MV2
5/12/2017	P48176 ACUEDUCTO BOG	Cobre Rdlos. Capital	2.434.000,00	BANCO DAVIVIENDA S.A	CDI	500.000.000,00	5/02/2018	COB51CD01MH9
6/12/2017	P48176 ACUEDUCTO BOG	Cobre Rdlos. Capital	10.318.000,00	BANCO FALABELLA S.A	CDI	2.000.000.000,00	6/09/2018	COB56CD0UWW:
11/12/2017	P48176 ACUEDUCTO BOG	Cobre Rdlos. Capital	7.376.250,00	ITAU CORPBANCA COLOMBIA S.A	CDI	350.000.000,00	11/03/2018	COB06CD0M277
12/12/2017	P48176 ACUEDUCTO BOG	Cobre Rdlos. Capital	10.008.000,00	BANCO DAVIVIENDA S.A	CDI	500.000.000,00	12/09/2018	COB51CD00Q08
20/12/2017	P48176 ACUEDUCTO BOG	Cobre Rdlos. Capital	7.563.000,00	BANCO DE BOGOTÁ S.A	CDI	1.500.000.000,00	20-AUG-2018	COB01CD05AM0

--

Total 39.093.250,00

VAR Y DURACIÓN

Fiduciaria Bogotá 

PORTAFOLIO	DURACIÓN (años)	TIR	VAR%	DURACIÓN MODIFICADA
Titularización EAAB	0,6052	5,22%	0,09%	0,6368



Calle 67 No. 7 -37 Piso 3 • Bogotá • Colombia • (571) 3485400 • www.fidubogota.com

VaR

TITULARIZACION EAAB

Corte: diciembre 2017

Fecha:

Valor del Portafolio: 25.476.943.964,37

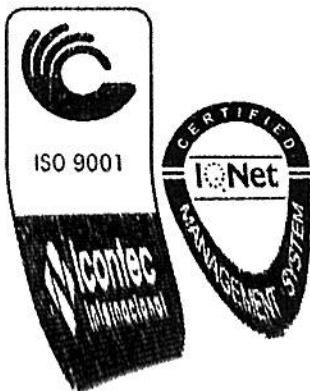
Factor de Riesgo

TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 1	7.243.215,09
TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 2	6.059.667,86
TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 3	934.878,71
TASA DE INTERÉS CEC UVR - COMPONENTE 1	-
TASA DE INTERÉS CEC UVR - COMPONENTE 2	-
TASA DE INTERÉS CEC UVR - COMPONENTE 3	-
TASA DE INTERÉS CEC TESOROS - COMPONENTE 1	-
TASA DE INTERÉS CEC TESOROS - COMPONENTE 2	-
TASA DE INTERÉS CEC TESOROS - COMPONENTE 3	-
TASA DE INTERÉS DTF - NODO 1 (CORTO PLAZO)	20.075.508,47
TASA DE INTERÉS DTF - NODO 2 (LARGO PLAZO)	-
TASA DE INTERÉS IPC	-
TASA DE CAMBIO - TRM	-
TASA DE CAMBIO - EURO / PESOS	-
PRECIO DE ACCIONES - IGBC	-
PRECIO DE ACCIONES - WORLD INDEX	-
CARTERAS COLECTIVAS	19.259,86

Total VaR No diversificado 22.213.272
% Sobre el Total del Portafolio 0,087%

Nota: 22.213.271,56

* Corresponde al Valor en Riesgo para un horizonte de 1 día y un nivel de confianza del 99%. Calculado de acuerdo con el método 25.476.943.964,37



DERIVADOS

Fiduciaria Bogotá 

Portafolio	Oper.	Operacion	Valor	Contraparte	Estado	Trader	Emision	Nominal	Tipos	Emision	Vencido	Medio Pago	DCV	Fecha
EL PORTAFOLIO NO TIENE OPERACIONES DE DERIVADOS														



