

SALDO FINAL			
FIDEICOMISO ACUEDUCTO DE BOGOTÁ			
A 30 DE SEPTIEMBRE DE 2017			
No. CUENTA	ENTIDAD FINANCIERA		VALOR
CORRIENTE	005-48699-8	HELM BANK	\$ 183,035,792.24
	00-6692602-8	CITIBANK	\$ 1,977,976,071.55
	00-452102074-7	COLPATRIA	\$ 7,950,011,647.93
			\$ 10,111,023,511.72
AHORROS	000-24200-8	ACUEDUCTO BOGOTA F.I	\$ 3,381,686,640.51
	000-24201-6	ACUEDUCTO BOGOTA F.P	\$ 7,085,734,850.29
	000-24202-4	ACUEDUCTO BOGOTA F.E.	\$ 10,834,393.42
	000-26975-3	ACUEDUCTO BOGOTA FPC	\$ 24,394,177,811.29
			\$ 34,872,433,695.51
FIC FIDUGOB	002001007857	FONDO EXCEDENTES	\$ 1,260,452.64
	000200157218	FONDO PRINCIPAL	\$ 974,434,203.22
			\$ 975,694,655.86
TOTAL			\$ 45,959,151,863.09
SALDO FINAL PORTAFOLIO			
No. CUENTA	ENTIDAD FINANCIERA		VALOR
AHORROS	870003696	BBVA	\$ 1,045,142,382.93
	5056926011	CITIBANK	\$ 243,545,504.16
	220009130832	POPULAR	\$ 5,370,187,860.19
			\$ 6,658,875,747.28
CTE	870003688	BBVA	\$ -
	66926036	CITIBANK	\$ -
	110009135856	POPULAR	\$ -
			\$ -
PORTAFOLIO			\$ 19,971,130,500.00
TOTAL			\$ 26,630,006,247.28
REDENCION PENDIENTE POR COBRAR			\$ -
PARTIDAS CONCILIATORIAS			\$ 713,313.99
GRAN TOTAL			\$ 72,589,871,424.36



PORTAFOLIO DE INVERSIONES

POR TIPO DE INVERSIÓN

Fiduciaria Bogotá 

PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN

PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN

INVERSIÓN	30-sep-17	PARTICIPACIÓN
CDIs	19,385,225,500	37.99%
TES Tasa fija	585,905,000	1.15%
Cuentas de Ahorro	31,051,464,379	60.86%
TOTAL	51,022,594,878.74	100.00%

Cuentas de Ahorro



60.86%

TES Tasa fija



1.15%

CDTs



37.99%

0.00% 20.00% 40.00% 60.00% 80.00%



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

fy

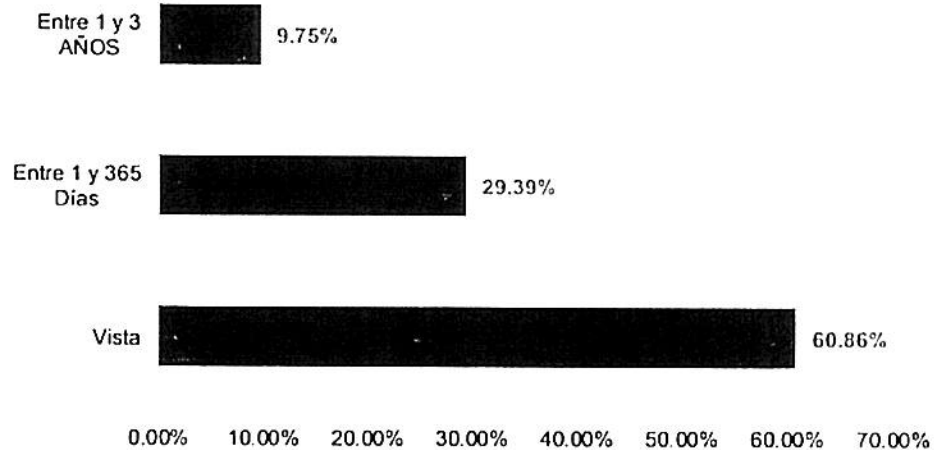
POR PLAZO

Fiduciaria Bogotá 

PORTAFOLIO POR PLAZO

PORTAFOLIO POR PLAZO

INVERSIÓN	30-sep-17	PARTICIPACIÓN
Vista	31,051,464,378.74	60.86%
Entre 1 y 365 Días	14,996,820,500.00	29.39%
Entre 1 y 3 AÑOS	4,974,310,000.00	9.75%
TOTAL	51,022,594,878.74	100.00%



POR EMISOR

Fiduciaria Bogotá 

PORTAFOLIO POR EMISOR

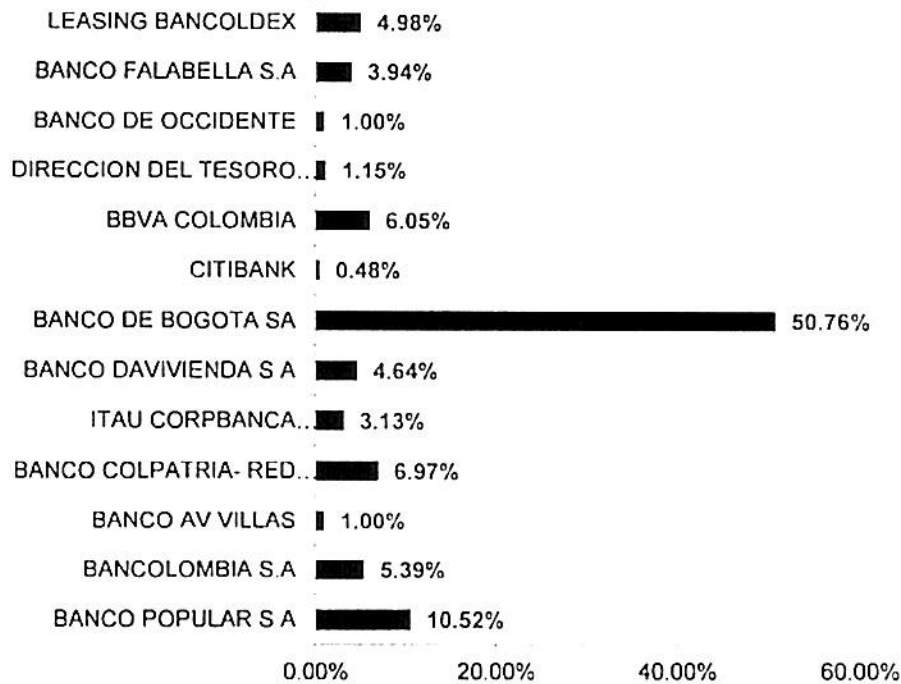
PORTAFOLIO POR EMISOR

INVERSIÓN	30-sep-17	PARTICIPACIÓN
BANCO POPULAR S.A.	5,368,598,680.35	10.52%
BANCOLOMBIA S.A.	2,748,119,000.00	5.39%
BANCO AV VILLAS	509,220,000.00	1.00%
BANCO COLPATRIA RED MULTIBANCA	3,554,790,000.00	6.97%
ITAU CORPBANCA COLOMBIA S.A.	1,596,426,500.00	3.13%
BANCO DAVIVIENDA S.A.	2,369,890,000.00	4.64%
BANCO DE BOGOTÁ S.A.	25,898,812,811.29	50.76%
CITIBANK	243,545,504.16	0.48%
BBVA COLOMBIA	3,084,352,382.94	6.05%
DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	585,905,000.00	1.15%
BANCO DE OCCIDENTE	510,225,000.00	1.00%
BANCO FALABELLA S.A.	2,012,560,000.00	3.94%
LEASING BANCOLDEX	2,540,150,000.00	4.98%
TOTAL	51,022,594,878.74	100.00%



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

fu



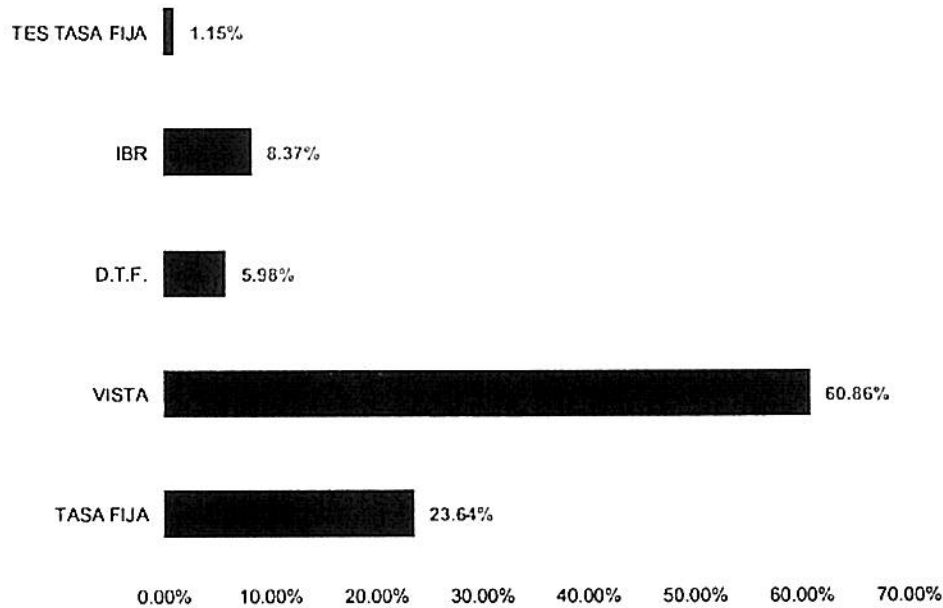
TIPO DE TASA

Fiduciaria Bogotá 

PORTAFOLIO POR TASA

PORTAFOLIO POR TIPO DE TASA

INVERSIÓN	30-sep-17	PARTICIPACIÓN
TASA FIJA	12,063,940,500.00	23.64%
VISTA	31,051,464,378.74	60.86%
D.T.F.	3,049,865,000.00	5.98%
IBR	4,271,420,000.00	8.37%
TES TASA FIJA	585,905,000.00	1.15%
TOTAL	51,022,594,878.74	100.00%



fin

RENTABILIDAD

ACUEDUCTO MENSUAL SEPTIEMBRE 2017

CONCEPTO	FECHA	VALOR
SALDO INICIAL	31/08/2017	46.615.595.475.86
APORTES	05/09/2017	1.658.894.653.67
INGRESO	26/09/2017	3.000.000.000.00
INGRESO	06/09/2017	2.507.000.000.00
EGRESO	25/09/2017	- 3.000.000.000.00
SALDO FINAL	30/09/2017	- 51.022.594.878.74

RENTABILIDAD	6.04%
---------------------	--------------

RENTABILIDAD MENSUAL SEPTIEMBRE 2017	6.04%
RENTABILIDAD DESDE NOVIEMBRE 2016	7.64%
RENTABILIDAD DESDE INICIO DEL NEGOCIO HASTA NOVIEMBRE DE 2016	8.33%

Fiduciaria Bogotá 

	Rentabilidad mensual	Rentabilidad Acumulada	TIR Portafolio
Septiembre	6.04%	7.64%	6.25%

RENTABILIDAD Resumen



COMPRAS

Fiduciaria Bogotá

Sec.	Contable	Edic.	La Escri.	Compras	Yorl Compras	Yorl Personal	Muestro	Yorl Mercado	Yorl. (Cobro Cobro)	Yorl.	Personal	Recib.	Compras	Recib.	Margen Acord.	M. Compras	Recib. (Vale)	Yorl Precede
------	----------	-------	-----------	---------	--------------	---------------	---------	--------------	---------------------	-------	----------	--------	---------	--------	---------------	------------	---------------	--------------

Los registros de compras para esta página en la SO



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

Handwritten signature

VENTAS

Fiduciaria Bogotá

Fecha	Emisor	Al Emisor	Fecha Operación	Valor Operación	Valor Compra	Valor Inicial	Alcance	Fecha Compra	Fecha Emisión	Fecha Vencim.	Valor Nominal	Valor Actual	Valor Presente	Valor Realizado	Utilidad o Pérdida	IR	Det. al Vendedor
-------	--------	-----------	-----------------	-----------------	--------------	---------------	---------	--------------	---------------	---------------	---------------	--------------	----------------	-----------------	--------------------	----	------------------

No hay registros de ventas para este periodo en la BD



RENDIMIENTOS

Fiduciaria Bogotá

Fecha	Portafolio	Tipo Operación	Valor	Contraparte	Emisión	Moneda	Vencido	Bin
1/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	1.629.000.000,00	ECSC S.A.	CDI	1.500.000.000,00	1/09/2017	CCB32CD33554
4/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - Cobro Ratos - Capital	1.491.750,00	BANCOLOMBIA S.A.	CDI	250.000.000,00	2/02/2016	CCB67CD01MM2
5/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - Cobro Ratos - Capital	2.622.000,00	BANCO DAVIVIENDA S.A.	CDI	500.000.000,00	5/07/2016	CCB51CD01MM2
6/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - Cobro Ratos - Capital	11.072.000,00	BANCO FALABELLA S.A.	CDI	2.000.000.000,00	6/09/2016	CCB55CD0JWW2
8/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	510.537.500,00	BANCO DE OCCIDENTE	CDI	500.000.000,00	8/09/2017	CCB23CD37532
13/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	326.372.700,00	BANCO AV Villas	CDI	300.000.000,00	10/09/2017	CCB52CD35027
11/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - Cobro Ratos - Capital	7.376.250,00	TAU COFFRANCA COLOMBIA S.A.	CDI	350.000.000,00	11/03/2016	CCB36CD094277
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	1.000.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	1.000.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	1.000.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	1.000.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	100.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	100.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	400.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	400.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	1.000.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	1.000.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - Cobro Ratos - Capital	10.000.000,00	BANCO DAVIVIENDA S.A.	CDI	500.000.000,00	12/09/2016	CCB51CD00G06
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	1.000.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	1.000.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	1.000.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	1.000.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	5.000.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	5.000.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	500.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	500.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
12/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	2.000.000.000,00	DIRECCIÓN DEL TESORO NACIONAL	TES	2.000.000.000,00	12/09/2017	COL17C103474
15/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	408.430.000,00	BANCOLOMBIA S.A.	CDI	450.000.000,00	15/09/2017	CCB67CD02C08
16/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	510.541.000,00	BANCO AV Villas	CDI	500.000.000,00	17/09/2017	CCB52CD33153
20/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - Cobro Ratos - Capital	8.025.000,00	BANCO DE BOGOTÁ S.A.	CDI	1.500.000.000,00	20 AUG-2016	CCB01CD05A50
21/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	1.020.843.000,00	BANCO FINANCIERA S.A.	CDI	1.000.000.000,00	21/09/2017	CCB63CD06117
25/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	305.010.000,00	BANCO POPULAR S.A.	CDI	300.000.000,00	25/09/2017	CCB02CD12142
25/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	508.350.000,00	BANCO POPULAR S.A.	CDI	500.000.000,00	25/09/2017	CCB02CD12142
25/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	510.110.000,00	BANCO DAVIVIENDA S.A.	CDI	500.000.000,00	23/09/2017	CCB51CD00735
25/09/2017	F4817x	ACUERDO EOG - REDENCIÓN	815.730.400,00	BANCO DAVIVIENDA S.A.	CDI	800.000.000,00	23/09/2017	CCB51CD00735

Total 19.565.536.600,00

VAR Y DURACIÓN

Fiduciaria Bogotá

PORTAFOLIO	DURACIÓN (años)	TIR	VAR%	DURACIÓN MODIFICADA
Titularización EAB	0.5436	6.25%	0.04%	0.5776



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

fin

VaR

TITULARIZACION EAB
Corte: Septiembre 2017

Fecha:

Valor del Portafolio:

51.022.594.878,74

Factor de Riesgo:

TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 1	2.804.741,84
TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 2	2.054.094,96
TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 3	325.412,28
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)	15.145.452,80
TASA DE INTERÉS DTF - NODO 2 (LARGO PLAZO)	6.494.448,80
TASA DE INTERÉS IPC	
TASA DE CAMBIO - TRM	
TASA DE CAMBIO - EURO / PESOS	
PRECIO DE ACCIONES - IGBC	
PRECIO DE ACCIONES - WORLDINDEX	
CARTERAS COLECTIVAS	18.369,659

Total VaR No diversificado

18.369,659

% Sobre el Total del Portafolio

0.036%

Nota:

18.369,659,00

* Corresponde al Valor en Riesgo para un horizonte de 1 día y un nivel de confianza del 99%. Calculado de acuerdo con el método estándar reglamentado en la C.E. 051 de 2007 expedida por la Superintendencia Financiera de Colombia.

51.022.594.878,74

DERIVADOS

Fiduciaria Bogotá

Portafolio	Oper.	Operacion	Valor	Contraparte	Estado	Trade	Entren	Receiv	Tipov	Entren	Verde	Modo Pago	CCY	Fecha
------------	-------	-----------	-------	-------------	--------	-------	--------	--------	-------	--------	-------	-----------	-----	-------

EL PORTAFOLIO NO TIENE OPERACIONES DE DERIVADOS



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

7. CONCILIACIONES BANCARIAS

El proceso de conciliación bancaria es realizado por la Gerencia de Conciliaciones y en equipo con la Gerencia de Fiducia se definen las acciones pertinentes para la depuración de las partidas registradas; esta actividad cuenta con controles y un desarrollo de actividades tendientes a regularizar con la mayor oportunidad y en el menor plazo la cantidad y valor de las mismas.

La gestión abarca el envío y reporte permanente de las partidas conciliatorias y el trámite de depuración, dejando evidencia de dicha gestión con los soportes correspondientes. La Gerencia de Conciliaciones valida y regulariza las partidas actualizando la conciliación. Se realizan actividades de control y verificación dentro de todo el proceso que aseguran la calidad de la información por cada negocio.

A corte 30 de septiembre de 2017 se presentan partidas pendientes por conciliar de las diferentes Entidades Bancarias, así: Banco de Bogotá por valor de \$234.464,75, Banco Popular por valor de \$785.08, Banco BBVA por valor de \$69.906,00 y Banco Citibank por valor de \$408.158,16, los cuales corresponden a gastos bancarios cobrados por cada una de ellas, cabe aclarar que Fidubogotá realizó la solicitud del reintegro de dichos recursos a fin de subsanar dichas partidas.

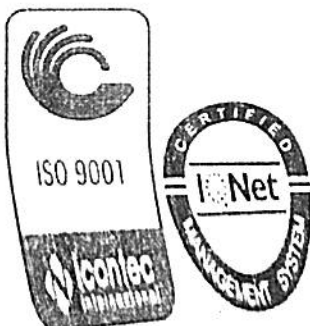
8. LÍNEA ÉTICA

Pensando siempre en crear líneas de comunicación efectivas con nuestros clientes, la Fiduciaria ha dispuesto un nuevo sistema de comunicación llamado línea ética, en el que usted podrá reportar irregularidades o conductas asociadas a:

- Fraude o error en la preparación, revisión, presentación y/o auditoría de los estados financieros.
- Pérdida de activos propios de la Fiduciaria o de los terceros que administra, producto de fraudes internos y/o externos (incluida la pérdida de información).
- Revelación de información contable incompleta, inexacta, falsa o que no corresponda con la realidad económica de la entidad o negocios y fondos administrados.
- Deficiencias o incumplimientos de los controles internos en los procesos contables de la entidad.
- Soborno o pagos por la facilitación de hechos corruptos

Usted puede dar a conocer sus denuncias a través de los siguientes canales de comunicación:

- Teléfono directo en Bogotá 3485400 Ext. 3104.
- Comunicación escrita dirigida a Contraloría, Calle 67 No. 7-37. Edificio Plaza 67 Tercer piso.
- Correo electrónico: lineaetica@fidubogota.com



Recuerde que la Línea Ética no debe utilizarse para presentar quejas o reclamos relacionados con la calidad de los servicios de Fiduciaria Bogotá S.A., en caso de requerirlo por favor comuníquese con nuestra Línea de Atención al cliente:

- o Teléfono directo en Bogotá 3485400 Ext. 8520
- o FIDULINEA 3486700 opción 9 en Bogotá D.C
- o Gratis en el resto del país a través de la línea 01 8000 52 60 30 opción 9.

IV. ANEXOS

Anexo No. 1 Intereses cancelados (hasta septiembre de 2017)

Anexo No. 2 Flujo de Caja

Anexo No. 3 Cálculo Indicador de Recaudo

Anexo No. 4 Estados Financieros

Anexo No. 5 Extractos

Anexo No. 6 Ficha Técnica

Anexo No. 7 Documento Actualización SARLAFT



ANEXO No. 1

INTERESES CANCELADOS (HASTA SEPTIEMBRE DE 2017)



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

29
14