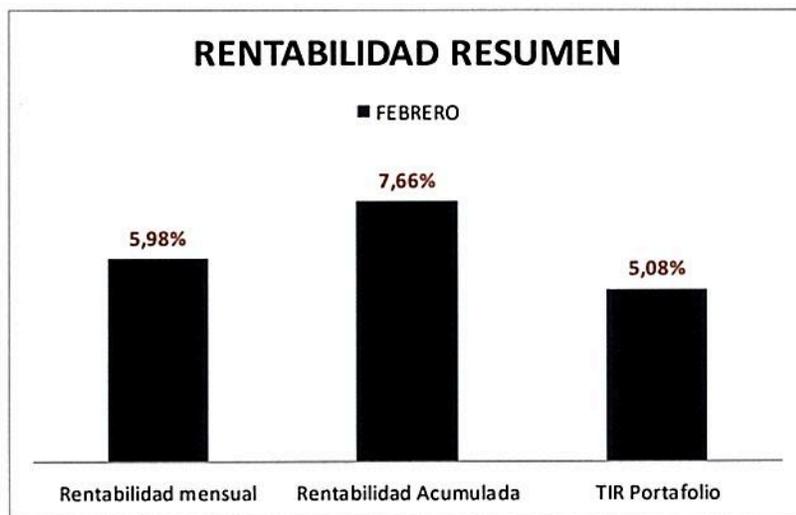


	Rentabilidad mensual	Rentabilidad Acumulada	TIR Portafolio
FEBRERO	5,98%	7,66%	5,08%



COMPRAS



Sec.	Clase Titulo	Emisor	Id. Emisor	Fecha Compra	Valor Compra	Valor Nominal	Moneda	Valor Mercado	Fecha Emision	Fecha Vcmlo.	Tasa Nominal	Modal.	TIR de Compra	TIR Resumen	Dial al Vcmlo	Valor Presente
274	C.D.I. Est. Credito	Banco Davivienda S A	860034313	5/02/2018	500.000.000	500.000.000	Peso	501.735.000	5/02/2018	5/10/2018	5,3525	PV	5,4305	5,4305	242,00	500.072.446
276	C.D.I. Est. Credito	Banco Av Villas	860033827	7/02/2018	507.500.000	500.000.000	Peso	509.080.000	07-apr-2017	7/10/2018	6,73	TV	5,4204	5,4986	242,00	507.255.000
278	C.D.I. Est. Credito	Banco Popular S A	860007738	8/02/2018	506.095.000	500.000.000	Peso	507.615.000	19/09/2017	19/09/2018	5,9652	TV	5,4163	5,4858	223,00	505.895.000
279	C.D.I. Est. Credito	Banco Popular S A	860007738	8/02/2018	508.590.000	500.000.000	Peso	502.285.000	25-aug-2017	2018	6,1564	TV	5,4317	5,4688	198,00	508.495.000
282	C.D.I. Est. Credito	Banco Av Villas	860033827	8/02/2018	1.522.575.000	1.500.000.000	Peso	1.527.240.000	07-apr-2017	7/10/2018	6,73	TV	5,4359	5,4968	241,00	1.522.005.000
284	Tes	Direccion Del Tesoro Nacional	899999070	8/02/2018	973.484.000	1.000.000.000	Peso	973.968.591	12/09/2017	12/09/2018	0	PV	4,6459	4,6459	216,00	973.605.125
286	C.D.I. Est. Credito	Banco Colpaltra	860034594	12/02/2018	512.210.000	500.000.000	Peso	513.560.000	3/10/2016	3/10/2018	7,865	TV	5,4604	5,472	233,00	512.175.000
287	Tes	Direccion Del Tesoro Nacional	899999090	12/02/2018	974.095.000	1.000.000.000	Peso	977.040.000	12/09/2017	11/09/2018	0	PV	4,6449	4,6449	211,00	974.090.000
289	C.D.I. Est. Credito	Banco Fajabella	900047981	12/02/2018	1.011.850.000	1.000.000.000	Peso	1.014.160.000	28/06/2017	28/06/2018	6,3473	TV	5,4206	5,3782	136,00	1.012.000.000
294	C.D.I. Est. Credito	Bbva Colombia	860003020	19/02/2018	1.023.400.000	1.000.000.000	Peso	1.024.910.000	13/10/2016	13/10/2018	7,7706	TV	5,4407	5,4179	236,00	1.023.540.000
295	C.D.I. Est. Credito	Banco Colombia S.A	890903938	19/02/2018	1.070.760.000	1.000.000.000	Peso	1.072.230.000	06-apr-2017	6/10/2018	7,121	PV	5,4204	5,4157	229,00	1.070.790.000

## VENTAS

Título	Sec. Via	Clase Título	Emisor	Id. Emisor	Fecha Operacion	Valor Operacion	Valor Compra	Valor Nominal
93	37	C.D.T. Est.	Itau	890.903.937	43.145	356.104.000	353.591.000	350.000.000

Moneda	Fecha Compra	Fecha Emision	Fecha Vcmto.	Tasa Nominal	Vigencia Tasa	TIR de Compra	Margen Inicial	Margen Actual
Peso	21-dec-2016	11-mar-16	11-mar-18	8,4298	0	7,9908	1,7034	0,06

Modal.	Valor Presente	Tasa Efectiva Venta	Utilidad o Perdida	TIR Resumen	Días al Vcmto
TV	356.041.000,00	5,344	63.000	5,39	38



## RENDIMIENTOS



Fecha	Portafolio	Tipo Operación	Valor	Contraparte	Emisión	Nominal	Vencido	Bin
2/02/2018	P-48176	ACUEDUCTO BOG	251.349.000,00	BANCOLOMBIA S.A	CDT	250.000.000,00	2/02/2018	CO807CD01M42
5/02/2018	P-48176	ACUEDUCTO BOG	502.321.500,00	BANCO DAVIVIENDA S A	CDT	500.000.000,00	5/02/2018	CO851CD01M49
6/02/2018	P-48176	ACUEDUCTO BOG	9.868.000,00	BANCO FALABELLA S.A	CDT	2.000.000.000,00	6/09/2018	CO856CD0JWW;
20/02/2018	P-48176	ACUEDUCTO BOG	7.225.500,00	BANCO DE BOGOTIA SA	CDT	1.500.000.000,00	20-AUG-2018	CO801CD05A00
22/02/2018	P-48176	ACUEDUCTO BOG	10.420.000,00	BANCOLOMBIA S.A	CDT	500.000.000,00	22-AUG-2018	CO807CD01S71
26/02/2018	P-48176	ACUEDUCTO BOG	7.700.000,00	BANCO POPULAR S A	CDT	500.000.000,00	25-AUG-2018	CO802CD19485
<b>Total</b>			<b>788.884.000,00</b>					



## VAR Y DURACIÓN



PORTAFOLIO	DURACIÓN (años)	TIR	VAR%	DURACIÓN MODIFICADA
Titularización EAAB	0,5156	5,08%	0,029%	0,5418



## VaR

### TITULARIZACION EAAB Corte: FEBRERO DE 2018

**Fecha:**

Valor del Portafolio: 43.013.574.724,90

**Factor de Riesgo**

TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 1	8.475.145,23
TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 2	8.280.409,81
TASA DE INTERÉS CEC PESOS - COMPONENTE 3	1.153.910,34
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)	10.129.803,63
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	418.666,29

**Total VaR No diversificado** 12.293.044  
**% Sobre el Total del Portafolio** 0,029%

**Nota:** 12.293.043,73

\* 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. 43.013.574.724,90



**ANEXO  
BALANCE**

**NOTAS ESTADOS FINANCIEROS**



## DERIVADOS

Fiduciaria Bogotá 

Portafolio	Oper.	Operacion	Valor	Contraparte	Estado	Trader	Emission	Nominal	Tipiv	Emission	Vencio	Medio Pago	CCV	Fecha
EL PORTAFOLIO NO TIENE OPERACIONES DE DERIVADOS														



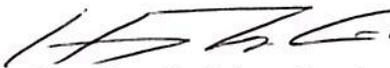
FIDUCIARIA BOGOTÁ S.A.  
 FIDUCIA MERCANTIL IRREVOCABLE EMPRESA DE ACUEDUCTO, ALCANTARILLADO Y ASEO DE BOGOTA  
 E.S.P. (3-2-48176)

Balances Generales  
 Al 28 de febrero y 31 de enero de 2018  
 (Expresados en millones de pesos)

<u>Activo</u>	28 de febrero de 2018	31 de enero de 2018
Disponible (nota 3)	\$ 19,103.5	29,288.2
Inversiones (nota 4)	40,362.4	33,273.2
Cuentas por cobrar (nota 5)	<u>100,000.0</u>	<u>100,000.0</u>
	<u>159,465.9</u>	<u>162,561.4</u>
Cuentas de orden deudoras (nota 10)	\$ <u>77,582.8</u>	<u>61,555.2</u>
<u>Pasivos y Bienes Fideicomitados</u>		
<u>Pasivo</u>		
Cuentas por pagar (nota 6)	\$ 841.2	156.4
Titulos de inversion en circulacion (nota 7)	<u>100,000.0</u>	<u>100,000.0</u>
	<u>100,841.2</u>	<u>100,156.4</u>
Bienes Fideicomitados (nota 8)		
Acreeedores Fiduciarios	\$ 293,598.2	296,896.6
Resultado de ejercicios Anteriores	(233,925.5)	(233,925.5)
Resultados del Ejercicio	<u>(1,048.0)</u>	<u>(566.1)</u>
	<u>58,624.7</u>	<u>62,405.0</u>
Total Pasivo y Bienes Fideicomitados	\$ <u>159,465.9</u>	<u>162,561.4</u>
Cuentas de orden deudoras por contra (nota 10)	\$ <u>77,582.8</u>	<u>61,555.2</u>

Véanse las Notas que acompañan a los Estados Financieros.

  
 Julián García Suárez  
 Representante Legal

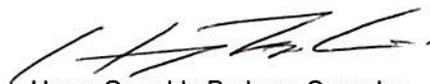
  
 Henry Oswaldo Pedraza Corredor  
 Contador  
 T.P. 46290 - T

FIDUCIARIA BOGOTÁ S.A.  
 FIDUCIA MERCANTIL IRREVOCABLE  
 EMPRESA DE ACUEDUCTO, ALCANTARILLADO Y ASEO DE BOGOTÁ. E.S.P. (3-2-48176)  
 Estado de Ingresos y Gastos  
 Al 28 de febrero y 31 de enero de 2018  
 (Expresado en millones de pesos)

	<u>28 de febrero de 2018</u>	<u>31 de enero de 2018</u>
Ingresos operacionales		
Utilidad en valoración inversiones negociables		
títulos participativos	\$ 25.2	42.6
títulos de deuda	178.1	143.7
	<u>\$ 203.3</u>	<u>186.3</u>
Gastos y costos operacionales (nota 9)		
Intereses	\$ 684.8	750.3
Otros gastos operacionales	0.4	2.1
	<u>\$ 685.2</u>	<u>752.4</u>
 Resultado del ejercicio	 <u>\$ (481.9)</u>	 <u>(566.1)</u>

Véanse las notas que acompañan a los estados financieros.

  
 Julián García Suárez  
 Representante legal

  
 Henry Oswaldo Pedraza Corredor  
 Contador  
 T.P. 46290 - T

FIDUCIARIA BOGOTÁ S.A.  
FIDUCIA MERCANTIL IRREVOCABLE EMPRESA DE ACUEDUCTO, ALCANTARILLADO Y ASEO DE  
BOGOTA E.S.P.

Notas a los Estados Financieros  
Al 28 de febrero y 31 de enero de 2018  
(Expresadas en millones de pesos)

**(1) Entidad Reportante**

Fiduciaria Bogotá, S.A. y La Empresa De Acueducto y Alcantarillado De Bogotá ESP, empresa de servicios públicos domiciliarios mediante contrato celebrado el 1 de diciembre de 2014 constituyeron una fiducia mercantil irrevocable de administración y pagos denominada fideicomiso Acueducto Bogotá (3-2-48176). La fiducia inició operaciones el 4 de diciembre del 2014 en Fiduciaria Bogotá y la duración del contrato será hasta que se rediman los títulos TAB.

Por instrucción del fideicomitente, los saldos fueron trasladados del contrato fiduciario (32082) de Fiduciaria Corficolombiana S.A., manteniendo la continuidad operativa del contrato en mención. Los saldos de las cuentas fueron trasladados con corte a 4 de diciembre de 2014 por instrucción del fideicomitente así:

Concepto	Valor
Disponible	\$ 1.514,4
Inversiones	6.864,8
Cuenta por cobrar	250.000,0
Otras activos	3,5
Total activo	<u>258.382,7</u>
Cuenta por pagar	1.910,6
Otros pasivos	250.000,0
Total Pasivos	<u>251.910,6</u>
Bienes Fideicomitidos	<u>6.472,1</u>
Total Pasivos y Bienes fideicomitidos	\$ <u>258.382,7</u>

El objeto del contrato es emitir títulos de contenido crediticio denominados Títulos TAB Acueducto de Bogotá para ser colocados en el segundo mercado por los agentes colocadores. En consecuencia, tales títulos solo podrán ser adquiridos y negociados por aquellas personas autorizadas para participar en el segundo mercado.

Los TAB corresponden a una emisión desmaterializada cuya representación se da a través de anotaciones en cuenta, de cuya administración se ha encargado a un Depósito Centralizado de Valores a través de sistemas electrónicos, quien en consecuencia emite constancias de depósito, documentos que legitiman a los depositantes para ejercer los derechos políticos o patrimoniales que confieran los valores.

El Fideicomiso Acueducto de Bogotá publicó el primer aviso de oferta pública el 25 de Octubre de 2006 por valor de \$250.000,0. El monto total de emisión aprobada fue \$300.000,0

(Continúa)

FIDUCIARIA BOGOTÁ S.A.  
FIDUCIA MERCANTIL IRREVOCABLE EMPRESA DE ACUEDUCTO, ALCANTARILLADO Y ASEO DE  
BOGOTÁ E.S.P.  
Notas a los Estados Financieros

La colocación se realizó con mecanismo de adjudicación mediante subasta holandesa, con los siguientes resultados:

<b>RESUMEN DE COLOCACIÓN POR SERIE TÍTULOS TAB FIDEICOMISO EAAB</b>			
<b>OCTUBRE 26 DE 2006</b>			
<b>Subserie</b>	<b>2a</b>	<b>2b</b>	<b>2c</b>
Valor nominal oferta y colocado	100.000,0	50.000,0	100.000,0
Fecha de colocación	26-Oct-06	26-Oct-06	26-Oct-06
Fecha de vencimiento	26-Oct-16	26-Oct-17	26-Oct-18
Precio de corte	5,0	5,1	4,9
Base liquidación	365 días	365 días	365 días
Periodicidad	T.V.	T.V.	T.V.
IPC al Inicio Período Causación	4,6%	4,6%	4,6%

(Expresado en millones)

Mediante otrosí No.1 celebrado el 8 de noviembre de 2007 se adicionó al numeral 9.4 de la cláusula novena del contrato inicial, el inciso acerca de la transferencia de los excedentes generados por el fondo, la cual se hará de acuerdo a la periodicidad que el fideicomitente señale, transfiriéndolos en moneda legal colombiana o títulos de tesorería TES.

Mediante contrato de cesión de posición contractual celebrado el 1 de diciembre de 2014, en virtud de la comunicación emitida por el Ministerio de Vivienda mediante oficio 2014EE0060224 por la cual se manifiesta la inhabilidad sobreviniente a la Fiduciaria Corficolombiana establecida en el artículo 9 de la Ley 80 de 1993, se realiza cesión a Fiduciaria Bogotá S.A, quien se hace responsable del cumplimiento de las obligaciones contractuales que la fiduciaria cedente tenía para con la Empresa de Acueducto, Alcantarillado y Aseo de Bogotá E.S.P.

La fiducia se encuentra activa al cierre del periodo y su última rendición de cuentas se presentó al corte del 28 de febrero de 2018 con periodicidad mensual.

**(2) Principales Políticas y Prácticas Contables**

**(a) Normas Básicas Contables**

La fiducia lleva su contabilidad, independiente de la contabilidad de la Sociedad Fiduciaria. La contabilidad se lleva de acuerdo con principios de contabilidad generalmente aceptados en Colombia e instrucciones de la Superintendencia Financiera de Colombia.

**(b) Disponible**

Registra los recursos de alta liquidez con que cuenta el fideicomiso, como depósitos en bancos y otras entidades financieras.

**(c) Inversiones**

Incluye las inversiones adquiridas por el fideicomiso con la finalidad de mantener una reserva secundaria de liquidez, cumplir con disposiciones legales o reglamentarias, o con el objeto



(Continúa)