

INFORME C.E 054 SFC

FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS VALORES

Composición del portafolio por tipo de inversión (CDTs, bonos, TES, cheques, libranzas, sentencias, entre otros) y la participación de este sobre el valor total del portafolio (en porcentajes).

COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN	
TIPO DE INVERSIÓN	% DEL PORTAFOLIO
FACTURAS	46,30%
PAGARES	35,77%
CUENTAS BANCARIAS	10,74%
BPEN (SIMULTANEAS)	0,42%
TSTF (SIMULTANEAS)	3,82%
CERT.DEPOSITO TERMIN	1,17%
CERT.DEPOSITO TERMINO BANCARIO	1,12%
LETRAS	0,43%
LIBRANZAS	0,15%
BONO LEASING BANCOLOMBIA	0,08%
TOTAL	100,00%

Participación por sector económico y región geográfica sobre el total del portafolio de dichos títulos, teniendo en cuenta para la determinación de la actividad económica, la clasificación CIIU por división (a dos dígitos). En el caso de créditos de libranza, la ubicación geográfica y actividad económica será la del pagador. En los demás casos y sentencias judiciales la ubicación geográfica y actividad económica será la de la persona obligada a hacer el pago de conformidad con el título valor u otro documento que incorpore o evidencie el derecho de contenido económico no inscritos en el RNVE.

COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR REGIÓN GEOGRÁFICA				
NOMBRE DEL PAGADOR	SECTOR ECONOMICO	UBICACIÓN GEOGRAFICA	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
PERSONAS NATURALES	Asalariados	BOGOTA	\$ 10.137,43	24,671%
INGENIO LA CABANA SA	Elaboración y refinación de azúcar	CALI	\$ 9.072,18	22,079%
MERCADERIA SAS	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	BOGOTA	\$ 5.211,50	12,683%
MAKRO SUPERMAYORISTA SAS	Comercio al por mayor no especializado	BOGOTA	\$ 4.885,04	11,889%
COMFENALCO VALLE DELAGENTE	Otras actividades recreativas y de esparcimiento n.c.p.	CALI	\$ 4.043,82	9,841%
BMC BOLSA MERCANTIL DE COLOMBIA SA	Otras actividades relacionadas con el mercado de valores	BOGOTA	\$ 3.381,73	8,230%
COMFENALCO ANTIOQUIA	Otras actividades recreativas y de esparcimiento n.c.p.	MEDELLIN	\$ 2.415,05	5,877%
CERT.DEPOSITO TERMIN	Sector Financiero	BOGOTA	\$ 564,50	1,374%
CERT.DEPOSITO TERMINO BANCARIO	Sector Financiero	BOGOTA	\$ 541,69	1,318%
COMUNICACION CELULAR COMCE	Actividades de telecomunicaciones inalámbricas	BOGOTA	\$ 517,41	1,259%
KOBA COLOMBIA SAS	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	TOCANCIPA	\$ 275,40	0,670%
BONO LEASING BANCOLOMBIA	Sector Financiero	BOGOTA	\$ 38,43	0,094%

INFORME C.E 054 SFC
FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS
VALORES

ESTRUMETALICAS JAMA SAS	Terminación y acabado de edificios y obras de ingeniería civil	BOGOTA	\$	5,98	0,015%
TOTAL			\$	41.090,13	100%

Información por tipo de inversión (libranzas, cheques, facturas, sentencias, entre otros) que componen el portafolio, respecto del número de operaciones, el monto agregado del saldo de cada tipo de obligación, y la proporción del monto agregado del saldo de cada tipo de obligación que está ubicada en cada calificación de crédito, según lo dispuesto en el parágrafo 3 del numeral 6.4. Del Capítulo I-1 de la CBCF, como se indica en la tabla a continuación:

COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN								
TIPO DE OBLIGACION	No DE OPERACIONES	MONTO	A	B	C	D	E	F
			SIN MORA	ENTRE 1 Y 5 DÍAS	ENTRE 6 Y 20 DÍAS	ENTRE 21 Y 60 DÍAS	ENTRE 61 - 90 DÍAS	MAS DE 90 DÍAS
FACTURAS	608	\$ 22.376,57	\$ 22.376,57					
PAGARES	7.974	\$ 17.289,30	\$ 17.284,12	\$ 0,06				\$ 5,12
CERT.DEPOSITO TERMIN	1	\$ 564,50	\$ 564,50					
CERT.DEPOSITO TERMINO BANCARIO	1	\$ 541,69	\$ 541,69					
LETRAS	109	\$ 206,26	\$ 103,36	\$ 0,02	\$ 1,87	\$ 24,67	\$ 17,68	\$ 58,66
LIBRANZAS	261	\$ 73,39	\$ 61,92			\$ 0,69	\$ 10,78	
BO LEASING BANCOLOMBIA	1	\$ 38,43	\$ 38,43					
TOTAL	8.955,00	41.090,13	40.966,38	0,08	1,87	25,37	21,89	74,56

Información que permita identificar la mora y la evolución de los prepagos por tipo de título, expresados en porcentajes sobre el monto agregado del portafolio del título valor u otro documento que incorpore o evidencie el derecho de contenido económico no inscritos en el RNVE, de los últimos 5 años o del tiempo en que el fondo lleve en operación si éste es menor.

EVOLUCION DE MORAS					
TIPO DE OBLIGACION	2021	2020	2019	2018	2017
PAGARES	0,05%	0,24%	0,00%	0,00%	0,00%
FACTURAS	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
LIBRANZAS	0,04%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%
LETRAS	0,25%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BONOS	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
CDT	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

EVOLUCION DE PREPAGOS					
TIPO DE OBLIGACION	2021	2020	2019	2018	2017
PAGARES	2,16%	11,09%	0,00%	1,80%	71,20%
FACTURAS	3,55%	1,07%	0,00%	0,00%	21,50%

INFORME C.E 054 SFC
FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS
VALORES

LIBRANZAS	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
LETRAS	0,01%	0,00%	0,00%	1,51%	35,70%
BONOS	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
CDT	0,00%	0,00%	0,00%	1,51%	35,70%