

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
BANCOS	41.42%
FACTURAS	31.47%
PAGARES	24.18%
CDTS	2.15%
TSTF (SIMULTANEAS)	0.44%
LETRAS	0.25%
LIBRANZAS	0.09%
TOTAL	100%

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	\$ 8,000.44	28.65%
MAKRO SUPERMAYORISTA S.A.S.	Comercio al por mayor no especializado	BOGOTA	\$ 5,209.66	18.66%
INGENIO LA CABANA S.A.	Elaboración y refinación de azúcar	CALI	\$ 4,157.28	14.89%
MERCADERIA S.A.S.	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	BOGOTA	\$ 3,489.87	12.50%
COMFENALCO VALLE DE LA GENTE	Otras actividades recreativas y de esparcimiento n.c.p.	CALI	\$ 3,089.76	11.06%
CIA GALLETAS NOEL	Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p.	MEDELLIN	\$ 2,258.28	8.09%
BMC BOLSA MERCANTIL DE COLOMBIA S.A.	Otras actividades relacionadas con el mercado de valores	BOGOTA	\$ 679.94	2.43%
BBVA COLOMBIA S.A	Sector Financiero	BOGOTA	\$ 529.01	1.89%
SCOTIABANK COLPATRIA	Sector Financiero	BOGOTA	\$ 505.17	1.81%
ESTRUMETALICAS JAMA S.A.S.	Terminación y acabado de edificios y obras de ingeniería civil	BOGOTA	\$ 6.41	0.02%
TOTAL			\$ 27,925.83	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:

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

COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN								
Tipo	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 y 90 Días	Más de 90 días
FACTURAS	396	\$ 15,604.64	\$ 13,962.08	634.46	808.25	199.84	0.00	0.00
PAGARES	6542	\$ 11,882.33	\$ 8,780.34	614.82	499.50	1,341.24	641.31	5.12
LIBRANZAS	201	\$ 48.30	\$ 4.74	1.53	0.00	38.04	0.00	3.99
LETRAS	126	\$ 146.25	\$ 119.62	7.75	4.88	9.87	4.12	0.00
CERT.DEPOSITO TERMIN	2	\$ 1,034.18	\$ 1,034.18	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	7,267	\$ 28,715.70	\$ 23,900.97	1,258.56	1,312.63	1,588.99	645.44	9.11

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
LETRAS	95.47%	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%
LIBRANZAS	79.00%	71.67%	0.00%	0.00%	0.00%
PAGARES	32.58%	62.12%	0.00%	0.00%	0.00%
FACTURAS	5.17%	3.04%	0.00%	0.00%	0.00%
CDT	0.00%	100.00%	0.00%	0.00%	0.00%

EVOLUCION DE PREPAGOS					
TIPO DE OBLIGACION	2021	2020	2019	2018	2017
PAGARES	39.18%	0.84%	0.00%	1.80%	71.20%
FACTURAS	33.76%	0.07%	0.00%	0.00%	21.50%
LIBRANZAS	19.91%	24.33%	0.00%	0.00%	0.00%
LETRAS	3.55%	0.00%	0.00%	1.51%	35.70%
CDT	0.00%	0.00%	0.00%	1.51%	35.70%