

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 EN %	
TIPO DE TITULO	% DEL PORTAFOLIO
FACTURAS	44.66%
PAGARES	25.98%
CUENTAS BANCARIAS	21.09%
DERECONOMICO	5.69%
CDT	2.26%
LETRAS	0.25%
LIBRANZAS	0.07%
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	\$7,342.39	20.57%
CIA GALLETAS NOEL	Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p.	MEDELLIN	\$5,546.68	15.54%
MAKRO SUPERMAYORISTA SAS	Comercio al por mayor no especializado	BOGOTA	\$5,137.23	14.39%
INGENIO LA CABANA SA	Elaboración y refinación de azúcar	CALI	\$4,167.00	11.67%
COMFENALCO VALLE DELAGENTE	Otras actividades recreativas y de esparcimiento n.c.p.	CALI	\$2,772.71	7.77%
KOBA COLOMBIA SAS	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	BOGOTA	\$2,685.31	7.52%
MERCADERIA SAS	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	BOGOTA	\$2,671.90	7.48%
BMC BOLSA MERCANTIL DE COLOMBIA SA	Otras actividades relacionadas con el mercado de valores	BOGOTA	\$1,775.91	4.97%
CENCOSUD SA	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	BOGOTA	\$1,417.02	3.97%
INCOLMOTOS YAMAHA SA	Fabricación de motocicletas	BOGOTA	\$1,159.06	3.25%
BBVA COLOMBIA S.A	Bancos comerciales	BOGOTA	\$518.25	1.45%
BCO. COLP. RED MUL	Bancos comerciales	BOGOTA	\$502.84	1.41%
ESTRUMETALICAS JAMA SAS	Terminación y acabado de edificios y obras de ingeniería civil	BOGOTA	\$6.59	0.02%
TOTAL			\$35,702.89	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 párrafo 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

COMPOSICION DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSION								
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	442	20,208.12	19,126.37	13.17	563.57	398.87	106.14	0.00
PAGARES	5851	11,754.59	11,685.31	23.53	24.22	15.75	0.65	5.12
DERECONOMICO	115	2,576.08	2,576.08	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
LIBRANZAS	201	30.54	29.59	0.18	0.00	0.39	0.39	0.00
LETRAS	106	112.47	92.18	5.07	4.88	6.89	3.45	0.00
CDT	2	1,021.09	1,021.09	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Sin Mora	6,717	35,702.89	34,530.63	41.94	592.68	421.90	110.63	5.12

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 PREPAGOS Y MORAS				
Año	Tipo	Prepagos	Mora	Al Tiempo
2020	FACTURAS	0.07%	3.04%	96.89%
2020	LETRAS	0.00%	100.00%	0.00%
2020	LIBRANZAS	24.33%	71.67%	4.00%
2020	PAGARES	0.81%	63.48%	35.71%
2021	FACTURAS	30.16%	15.78%	54.06%
2021	LETRAS	4.02%	94.87%	1.11%
2021	LIBRANZAS	20.74%	79.26%	0.00%
2021	PAGARES	35.87%	33.89%	30.24%