

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 | 32.40% |
| PAGARES | 12.82% |
| CUENTAS BANCARIAS | 32.12% |
| DERECONOMICO | 11.54% |
| CDT | 2.41% |
| LETRAS | 8.70% |
| LIBRANZAS | 0.01% |
| 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 | \$6,328.78 | 23.28% |
| MAKRO SUPERMAYORISTA SAS | Comercio al por mayor no especializado | BOGOTA | \$5,450.86 | 20.05% |
| INGENIO LA CABANA SA | Elaboración y refinación de azúcar | CALI | \$4,495.88 | 16.54% |
| CIA GALLETAS NOEL | Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p. | MEDELLIN | \$2,567.13 | 9.44% |
| COMFENALCO VALLE DELAGENTE | Otras actividades recreativas y de esparcimiento n.c.p. | CALI | \$2,286.87 | 8.41% |
| INCOLMOTOS YAMAHA SA | Fabricación de motocicletas | BOGOTA | \$1,230.85 | 4.53% |
| CENCOSUD SA | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco | BOGOTA | \$1,168.17 | 4.30% |
| BBI COLOMBIA SAS | Arrendamiento de propiedad intelectual y productos similares, excepto obras protegidas por derechos de autor | BOGOTA | \$1,163.07 | 4.28% |
| ARROZ FEDERAL SAS | Elaboración de productos de molinería | ITAGUI | \$835.36 | 3.07% |
| BBVA COLOMBIA S.A | Bancos comerciales | BOGOTA | \$491.29 | 1.81% |
| BCO. COLP. RED MUL | Bancos comerciales | BOGOTA | \$473.42 | 1.74% |
| MERCADERIA SAS | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco | BOGOTA | \$459.86 | 1.69% |
| ALIMENTOS FINCA S.A.S. | Elaboración de alimentos preparados para animales | BOGOTA | \$105.06 | 0.39% |
| CONTEGRAL S.A.S. | Elaboración de alimentos preparados para animales | BOGOTA | \$62.79 | 0.23% |
| AVICOLA TRIPLE A S.A.S. | Cría de aves de corral | BOGOTA | \$56.59 | 0.21% |
| ESTRUMETALICAS JAMA SAS | Terminación y acabado de edificios y obras de ingeniería civil | BOGOTA | \$6.97 | 0.03% |
| TOTAL | | | \$27,182.95 | 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

INFORME C.E 054 SFC

FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS VALORES

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:

| 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 | 204 | 12,973.74 | 12,845.09 | 0.00 | 38.11 | 62.41 | 28.12 | 0.00 |
| PAGARES | 2416 | 5,132.64 | 4,938.73 | 193.91 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| DERECONOMICO | 2449 | 4,621.89 | 4,598.37 | 23.51 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| LIBRANZAS | 170 | 4.30 | 2.99 | 0.50 | 0.00 | 0.00 | 0.82 | 0.00 |
| LETRAS | 2350 | 3,485.68 | 3,469.17 | 7.02 | 3.70 | 3.48 | 2.31 | 0.00 |
| CDT | 2 | 964.70 | 964.70 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| SIN MORA | 7,591 | \$ 27,182.95 | \$ 26,819.06 | \$ 224.94 | \$ 41.81 | \$ 65.90 | \$ 31.25 | \$ - |

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 | 28.09% | 18.18% | 53.73% |
| 2021 | LETRAS | 10.12% | 82.91% | 6.97% |
| 2021 | LIBRANZAS | 19.70% | 79.93% | 0.37% |
| 2021 | PAGARES | 46.59% | 30.57% | 22.84% |
| 2022 | FACTURAS | 30.44% | 2.82% | 66.74% |
| 2022 | LETRAS | 18.44% | 68.35% | 13.20% |
| 2022 | LIBRANZAS | 10.68% | 89.32% | 0.00% |
| 2022 | PAGARES | 84.23% | 15.15% | 0.62% |