

# INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

## FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TÍTULOS 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 TÍTULO  | % DEL PORTAFOLIO |
| FACTURAS  | 33.21%           |
| PAGARES   | 10.42%           |
| CUENTAS BANCARIAS                                     | 36.97%           |
| DERECONOMICO  | 8.86%            |
| CDT   | 2.50%            |
| LETRAS  | 8.05%            |
| LIBRANZAS   | 0.00%            |
| <b>TOTAL</b>  | <b>100.00%</b>   |
| * Se incluye el total de las inversiones              |                  |

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 GEOGRÁFICA | VALOR (\$ MM)      | % DEL PORTAFOLIO |
| MAKRO SUPERMAYORISTA SAS                         | Comercio al por mayor no especializado   | BOGOTA               | \$5,375.90         | 24.21%           |
| PERSONAS NATURALES                               | Asalariados  | BOGOTA               | \$5,076.76         | 22.86%           |
| KOBA COLOMBIA SAS                                | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco                                     | BOGOTA               | \$2,954.05         | 13.30%           |
| CIA GALLETAS NOEL                                | Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p.   | MEDELLIN             | \$1,984.19         | 8.94%            |
| COMFENALCO VALLE DELAGENTE                       | Regulación de las actividades de organismos que prestan servicios de salud, educativos, culturales y otros servicios sociales, excepto servicios de seguridad social | CALI                 | \$1,423.53         | 6.41%            |
| INGENIO LA CABANA SA                             | Elaboración y refinación de azúcar   | CALI                 | \$1,258.92         | 5.67%            |
| INCOLMOTOS YAMAHA SA                             | Fabricación de motocicletas  | BOGOTA               | \$1,123.28         | 5.06%            |
| ARROZ FEDERAL SAS                                | Elaboración de productos de molinería  | ITAGUI               | \$834.92           | 3.76%            |
| BBI COLOMBIA SAS                                 | Expendio de comidas preparadas en cafeterías   | FUNZA                | \$732.28           | 3.30%            |
| BCO. COLP. RED MUL                               | Bancos comerciales   | BOGOTA               | \$440.30           | 1.98%            |
| BBVA COLOMBIA S.A                                | Bancos comerciales   | BOGOTA               | \$439.93           | 1.98%            |
| CENCOSUD SA                                      | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco                                     | BOGOTA               | \$298.60           | 1.34%            |
| MERCADERIA SAS                                   | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco                                     | BOGOTA               | \$126.73           | 0.57%            |
| ALIMENTOS FINCA S.A.S.                           | Elaboración de alimentos preparados para animales  | BOGOTA               | \$66.87            | 0.30%            |
| CONTEGRAL S.A.S.                                 | Elaboración de alimentos preparados para animales  | BOGOTA               | \$43.14            | 0.19%            |
| AVICOLA TRIPLE A S.A.S.                          | Cría de aves de corral   | BOGOTA               | \$20.40            | 0.09%            |
| ESTRUMETALICAS JAMA SAS                          | Terminación y acabado de edificios y obras de ingeniería civil   | BOGOTA               | \$4.82             | 0.02%            |
| <b>TOTAL</b>                                     |  |                      | <b>\$22,204.63</b> | <b>100%</b>      |

# INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

## FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TÍTULOS VALORES

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:

| 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   | 247          | 11,699.78           | 11,591.32           | 0.00             | 25.15             | 62.41              | 20.90              | 0.00           |
| PAGARES  | 1871         | 3,669.84            | 3,666.74            | 3.10             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| DERECONOMICO                                     | 1553         | 3,119.50            | 2,799.37            | 21.53            | 0.00              | 0.00               | 298.60             | 0.00           |
| LIBRANZAS  | 165          | 0.23                | 0.00                | 0.23             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| LETRAS   | 1902         | 2,835.05            | 2,826.37            | 8.68             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| CDT  | 2            | 880.23              | 880.23              | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| <b>SIN MORA</b>                                  | <b>5,740</b> | <b>\$ 22,204.63</b> | <b>\$ 21,764.03</b> | <b>\$ 33.53</b>  | <b>\$ 25.15</b>   | <b>\$ 62.41</b>    | <b>\$ 319.50</b>   | <b>\$ -</b>    |

\* No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas)

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                          | DERECONOMICO | 13.43%   | 84.42%  | 2.15%     |
| 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                          | DERECONOMICO | 71.91%   | 26.31%  | 1.78%     |
| 2022                          | FACTURAS     | 41.05%   | 11.71%  | 47.24%    |
| 2022                          | LETRAS       | 23.21%   | 72.29%  | 4.50%     |
| 2022                          | LIBRANZAS    | 11.26%   | 88.74%  | 0.00%     |
| 2022                          | PAGARES      | 61.84%   | 34.30%  | 3.85%     |