

# INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

## FONDO DE INVERSION COLECTIVA CERRADO

### RENTA CREDITO

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

| COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN EN % |                  |
|-------------------------------------------------------|------------------|
| TIPO DE TITULO                                        | % DEL PORTAFOLIO |
| FACTURAS                                              | 55.04%           |
| PAGARES                                               | 6.62%            |
| CUENTAS BANCARIAS                                     | 4.20%            |
| LETRAS                                                | 8.42%            |
| CONTRATO                                              | 21.63%           |
| SIMULTÁNEA BONOS PENSIONALES                          | 4.09%            |
| <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 GEOGRAFICA | VALOR (\$ MM)      | % DEL PORTAFOLIO |
| MAKRO SUPERMAYORISTA SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | Comercio al por mayor no especializado                                                                                                        | BOGOTÁ               | \$2,610.81         | 23.24%           |
| CERDOS DEL VALLE SA                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | Cría de ganado porcino                                                                                                                        | CALI                 | \$2,395.98         | 21.33%           |
| PERSONAS NATURALES                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | Asalariados                                                                                                                                   | BOGOTÁ               | \$1,713.92         | 15.26%           |
| COMPAÑIA DE GALLETAS NOEL SA                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p.                                                                                            | MEDELLÍN             | \$1,448.05         | 12.89%           |
| OPERADORA AVICOLA COLOMBIA SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | Procesamiento y conservación de carne y productos cárnicos                                                                                    | ENVIGADO             | \$1,093.79         | 9.74%            |
| PRODUCTOS RAMO SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | Elaboración de productos de panadería                                                                                                         | BOGOTÁ               | \$1,092.40         | 9.72%            |
| FEDERAL S.A.S                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Elaboración de productos de molinería                                                                                                         | ITAGÜÍ               | \$342.53           | 3.05%            |
| KOBA COLOMBIA SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco              | BOGOTÁ               | \$267.64           | 2.38%            |
| COQUECOL SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | Fabricación de productos de hornos de coque                                                                                                   | CALI                 | \$131.88           | 1.17%            |
| IVANGO SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | Transporte de pasajeros                                                                                                                       | BOGOTÁ               | \$128.59           | 1.14%            |
| SANTAS CARNITAS SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | Comercio al por menor de carnes (incluye aves de corral), productos cárnicos, pescados y productos de mar, en establecimientos especializados | MEDELLÍN             | \$15.84            | 0.14%            |
| MERCADERIA SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco              | BOGOTÁ               | \$3.18             | 0.03%            |
| GOLFO SEA FOOD SAS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | Procesamiento y conservación de pescados, crustáceos y moluscos                                                                               | MEDELLÍN             | -\$11.13           | -0.10%           |
| <b>TOTAL</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                               |                      | <b>\$11,233.49</b> | <b>100.00%</b>   |
| * No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas). La razón por la cual se reporta con saldo negativo la inversión de Golfo Sea Food obedece que actualmente los títulos se encuentran provisionados por altura de mora al 50%, por instrucción de la Junta Directiva de la Sociedad Administradora, esta inversión debe estar provisionada al 100%, independientemente de su edad de mora, por este motivo, se evidencia un valor en la inversión negativo, reflejando un pequeño exceso con respecto al deterioro reglamentario. |                                                                                                                                               |                      |                    |                  |

# INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

## FONDO DE INVERSION COLECTIVA CERRADO

### RENTA CREDITO

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:

| 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                                         | 135          | 6,741.50           | 6,738.32           | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 3.18               | 0.00           |  |
| PAGARES                                          | 552          | 810.95             | 810.95             | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |  |
| LIBRANZAS                                        | 25           | 0.00               | 0.00               | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |  |
| LETRAS                                           | 656          | 1,031.58           | 927.43             | 104.15           | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |  |
| CONTRATO                                         | 201          | 2,649.48           | 2,649.48           | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |  |
| <b>Sin Mora</b>                                  | <b>1,569</b> | <b>\$11,233.50</b> | <b>\$11,126.18</b> | <b>\$104.15</b>  | <b>\$0.00</b>     | <b>\$0.00</b>      | <b>\$3.18</b>      | <b>\$0.00</b>  |  |

\* No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas). Actualmente el portafolio cuenta con un total de provisiones por valor de 1123.53 MM cuyos títulos tienen calificación "F". Lo anterior, teniendo en cuenta los flujos vigentes y vencidos del portafolio.

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  | 42.64%   | 13.60%  | 43.76%    |
| 2020                          | LIBRANZAS | 0.00%    | 100.00% | 0.00%     |
| 2020                          | PAGARES   | 0.00%    | 77.19%  | 22.81%    |
| 2021                          | CONTRATO  | 0.00%    | 100.00% | 0.00%     |
| 2021                          | FACTURAS  | 42.73%   | 16.13%  | 41.14%    |
| 2021                          | LETRAS    | 18.15%   | 74.33%  | 7.52%     |
| 2021                          | LIBRANZAS | 0.00%    | 100.00% | 0.00%     |
| 2021                          | PAGARES   | 23.39%   | 58.36%  | 18.25%    |
| 2022                          | CONTRATO  | 33.52%   | 16.59%  | 49.89%    |
| 2022                          | FACTURAS  | 49.42%   | 6.89%   | 43.69%    |
| 2022                          | LETRAS    | 17.17%   | 76.15%  | 6.68%     |
| 2022                          | LIBRANZAS | 0.00%    | 100.00% | 0.00%     |
| 2022                          | PAGARES   | 64.66%   | 31.34%  | 4.00%     |