

## INFORME DE RIESGOS PÚBLICO FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND FACTURAS

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 porcentaje).

| COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN EN % |                  |
|-------------------------------------------------------|------------------|
| TIPO DE TÍTULO                                        | % DEL PORTAFOLIO |
| FACTURAS                                              | 84.45%           |
| CDT                                                   | 10.04%           |
| CUENTAS BANCARIAS                                     | 5.35%            |
| DERECONOMICO                                          | 0.17%            |
| <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 CIU 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 |                                             |                                                                                                         |                      |                   |                  |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|-------------------|------------------|
| Nit Pagador                                      | NOMBRE DEL PAGADOR                          | SECTOR ECONOMICO                                                                                        | UBICACIÓN GEOGRÁFICA | VALOR (\$ MM)     | % DEL PORTAFOLIO |
| 805018495                                        | CERDOS DEL VALLE S.A.                       | Cría de ganado porcino                                                                                  | CALI                 | \$685.13          | 14.33%           |
| 811022302                                        | FEDERAL S.A.S                               | Elaboración de productos de molinería                                                                   | ITAGÜÍ               | \$8.42            | 0.18%            |
| 900354302                                        | INVERSIONES LA BUONA VITA SAS               | Comercio al por mayor de productos alimenticios                                                         | ITAGÜÍ               | \$1,033.94        | 21.62%           |
| 860007955                                        | DETERGENTES LTDA                            | Fabricación de jabones y detergentes, preparados para limpiar y pulir; perfumes y preparados de tocador | BOGOTÁ               | \$498.64          | 10.43%           |
| 860008448                                        | MEALS MERCADEO DE ALIMENTOS DE COLOMBIA SAS | Comercio al por mayor de productos alimenticios                                                         | BOGOTÁ               | \$713.02          | 14.91%           |
| 819000939                                        | INTERASEO SAS ESP                           | Recolección de desechos no peligrosos                                                                   | SANTA MARTA          | \$488.32          | 10.21%           |
| 890903938                                        | BANCOLOMBIA S.A.                            | Bancos comerciales                                                                                      | BOGOTÁ               | \$507.20          | 10.61%           |
| 890901110                                        | CONSTRUCTORA CONCRETO SA                    | Construcción de carreteras y vías de ferrocarril                                                        | BOGOTÁ               | \$847.14          | 17.72%           |
| <b>TOTAL</b>                                     |                                             |                                                                                                         |                      | <b>\$4,781.81</b> | <b>100.00%</b>   |

\*No se incluyen cuentas de ahorro ni operaciones de liquidez (Operaciones Simultáneas)

## INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

### FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND FACTURAS

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<br>Sin Mora   | B<br>Entre 1 y 5 días | C<br>Entre 6 y 20 días | D<br>Entre 21 y 60 días | E<br>Entre 61 y 90 días | F<br>Más de 90 días |
| FACTURAS                                         | 77          | 4,266.19        | 4,266.19        | 0.00                  | 0.00                   | 0.00                    | 0.00                    | 0.00                |
| CDT                                              | 1           | 507.20          | 507.20          | 0.00                  | 0.00                   | 0.00                    | 0.00                    | 0.00                |
| DERECONOMICO                                     | 53          | 8.42            | 8.42            | 0.00                  | 0.00                   | 0.00                    | 0.00                    | 0.00                |
| <b>Sin Mora</b>                                  | <b>131</b>  | <b>4,781.81</b> | <b>4,781.81</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 2.250,95 MM cuyos títulos están calificados en "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 | 33.23%   | 1.67%   | 65.09%    |
| 2021                          | CONTRATO | 0.00%    | 100.00% | 0.00%     |
| 2021                          | FACTURAS | 30.22%   | 24.11%  | 45.67%    |
| 2022                          | CONTRATO | 7.93%    | 82.28%  | 9.79%     |
| 2022                          | FACTURAS | 45.87%   | 18.37%  | 35.77%    |
| 2023                          | CONTRATO | 1.33%    | 94.68%  | 3.99%     |
| 2023                          | FACTURAS | 39.30%   | 17.14%  | 43.57%    |
| 2024                          | CONTRATO | 1.78%    | 94.67%  | 3.55%     |
| 2024                          | FACTURAS | 14.71%   | 19.81%  | 65.47%    |