

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	37.91%
PAGARES	0.13%
CUENTAS BANCARIAS	14.50%
DERECONOMICO	25.35%
Certificados de Depósito a Término	7.58%
LETRAS	0.96%
SIMULTANEA ACTIVA	13.56%
TOTAL	100.00%
* 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					
Nit Pagador	NOMBRE DEL PAGADOR	SECTOR ECONOMICO	UBICACIÓN GEOGRÁFICA	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
	PERSONAS NATURALES	Asalariados	BOGOTA	\$437.58	1.52%
860003020	BBVA COLOMBIA S.A	Bancos comerciales	BOGOTA	\$499.68	1.73%
891401858	OPERADORA AVICOLA COLOMBIA SAS	Procesamiento y conservación de carne y productos cárnicos	ENVIGADO	\$290.80	1.01%
890916911	INCOLMOTOS YAMAHA SA	Fabricación de motocicletas	GIRARDOTA	\$538.26	1.87%
805018495	CERDOS DEL VALLE S.A.	Cría de ganado porcino	CALI	\$2,752.44	9.55%
811022302	FEDERAL SAS	Elaboración de productos de molinería	ITAGUI	\$334.83	1.16%
860000261	LEVAPAN SA	Elaboración de productos lácteos	BOGOTA	\$566.74	1.97%
900354302	INVERSIONES LA BUONA VITA SAS	Comercio al por mayor de productos alimenticios	ITAGUI	\$636.70	2.21%
860008448	MEALS MERCADEO DE ALIMENTOS DE COLOMBIA SAS	Comercio al por mayor de productos alimenticios	BOGOTÁ	\$422.09	1.46%
860007955	DETERGENTES LTDA	Fabricación de jabones y detergentes, preparados para limpiar y pulir; perfumes y preparados de tocador	BOGOTÁ	\$5,936.72	20.59%
819000939	INTERASEO SAS ESP	Recolección de desechos no peligrosos	SANTA MARTA	\$2,609.80	9.05%
901054344	CEE ENERGY SAS ESP	Comercialización de energía eléctrica	BOGOTÁ	\$1,172.34	4.07%
900407235	NEO DOMUS SUCURSAL COLOMBIA	Actividades inmobiliarias realizadas con bienes propios o arrendados	BOGOTÁ	\$7,568.93	26.26%
800109279	SUTRAK SAS	Fabricación de otros productos elaborados de metal n.c.p.	BOGOTÁ	\$858.51	2.98%
860034313	BANCO DAVIVIENDA S.A	Bancos comerciales	BOGOTÁ	\$2,539.49	8.81%
890901110	CONSTRUCTORA CONCONCRETO SA	Construcción de carreteras y vías de ferrocarril	MEDELLÍN	\$229.22	0.80%
900715610	BGREEN SAS	Elaboración de aceites y grasas de origen vegetal y animal	SANTA MARTA	\$1,432.12	4.97%
TOTAL				\$28,826.26	100.00%

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

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 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	136	15,191.43	14,745.77	445.66	0.00	0.00	0.00	0.00
PAGARES	37	53.43	53.43	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
DERECONOMICO	83	10,158.07	10,158.07	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
LETRAS	224	384.15	379.91	4.24	0.00	0.00	0.00	0.00
Certificados de Depósito a Término	2	3,039.17	3,039.17	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SIN MORA	\$ 520	\$ 28,826.26	\$ 28,376.35	\$ 449.90	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
* No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas). Actualmente el portafolio cuenta con un total de provisiones por valor de 2,848.82 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	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	CONTRATO	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	CONTRATO	65.64%	27.84%	6.53%
2022	FACTURAS	46.29%	10.61%	43.10%
2022	LETRAS	27.33%	67.01%	5.66%
2022	LIBRANZAS	16.91%	83.09%	0.00%
2022	PAGARES	55.78%	35.32%	8.91%
2023	CONTRATO	12.30%	7.75%	79.94%
2023	FACTURAS	22.28%	20.25%	57.47%
2023	LETRAS	40.52%	42.83%	16.65%
2023	LIBRANZAS	100.00%	0.00%	0.00%
2023	PAGARES	80.66%	13.01%	6.35%
2024	CONTRATO	9.74%	32.31%	57.95%
2024	FACTURAS	25.91%	15.08%	59%
2024	LETRAS	47.43%	37.17%	15.41%
2024	PAGARES	86.21%	7.84%	5.95%