

INFORME DE RIESGOS PUBLICO FIC 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 TITULO	% DEL PORTAFOLIO
FACTURAS	35,86%
CDT	28,36%
CUENTAS BANCARIAS	10,30%
DERECONOMICO	0,04%
SIMULTANEA ACTIVA	25,43%
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 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	\$945,48	20,58%
811022302	FEDERAL S.A.S	Elaboración de productos de molinería	ITAGÚÍ	\$3,13	0,07%
900354302	INVERSIONES LA BUONA VITA SAS	Comercio al por mayor de productos alimenticios	ITAGÚÍ	\$490,21	10,67%
860008448	MEALS MERCADEO DE ALIMENTOS DE COLOMBIA SAS	Comercio al por mayor de productos alimenticios	BOGOTÁ	\$847,18	18,44%
819000939	INTERASEO SAS ESP	Recolección de desechos no peligrosos	SANTA MARTA	\$280,41	6,10%
860003020	BBVA COLOMBIA S.A	Bancos comerciales	BOGOTÁ	\$2.027,19	44,13%
TOTAL				\$4.593,60	100,00%

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

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:

INFORME DE RIESGOS PUBLICO FIC CREDIT OPPORTUNITIES FUND FACTURAS

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	22	2.563,28	2.563,28	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CDT	2	2.027,19	2.027,19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
DERECONOMICO	44	3,13	3,13	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Sin Mora	68	4.593,60	4.593,60	-	-	-	-	-

* No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas). Actualmente el portafolio cuenta con un total de provisiones por valor de \$721.36 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	
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	2,22%	94,67%		3,11%
2024	FACTURAS	21,86%	13,12%		65,02%
2025	CONTRATO	1,78%	94,67%		3,55%
2025	FACTURAS	39,99%	17,15%		42,86%

Medellín

Calle 7 sur # 42 - 70
Torre 2. Ed. Forum. Of 219
Teléfono: (604) 6040705

Bogotá

Cra 7 # 71 - 21.
Edificio Avenida Chile Torre A. Piso 11
Teléfono: (601) 3905591

Cali

Calle 22N # 6AN - 24
Ed. Santa Mónica Of 204
Teléfono: (602) 4950706