

INFORME DE RIESGOS PÚBLICO FIC 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 TITULO	% DEL PORTAFOLIO
FACTURAS	24,01%
CUENTAS BANCARIAS	10,86%
DERECONOMICO	10,15%
Certificados de Depósito a Término	17,90%
Títulos de Tesorería - TES Pesos TF	10,50%
LETRAS	0,10%
SIMULTANEA ACTIVA	26,48%
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 ECONÓMICO	UBICACIÓN GEGRÁFICA	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
	PERSONAS NATURALES	Asalariados	BOGOTÁ	\$58	0,17%
860034594	BCO. COLP. RED MUL	Bancos comerciales	BOGOTÁ	\$6.083	17,26%
899999083	GOBIERNO REPUBLICA DE COLOMBIA	Banco Central	BOGOTÁ	\$5.908	16,76%
890916911	INCOLMOTOS YAMAHA SA	Fabricación de motocicletas	GIRARDOTA	\$204	0,58%
805018495	CERDOS DEL VALLE S.A.	Cría de ganado porcino	CALI	\$5.411	15,35%
811022302	FEDERAL SAS	Elaboración de productos de molinería	ITAGUI	\$312	0,89%
900354302	INVERSIONES LA BUONA VITA SAS	Comercio al por mayor de productos alimenticios	ITAGUI	\$3.849	10,92%
860008448	MEALS MERCADERO DE ALIMENTOS DE COLOMBIA SAS	Comercio al por mayor de productos alimenticios	BOGOTÁ	\$796	2,26%
900715610	BGREEN SAS	Elaboración de aceites y grasas de origen vegetal y animal	SANTA MARTA	\$1.753	4,97%
890301960	CARVAJAL PULPA Y PAPEL S.A	Fabricación de pulpas (pastas) celulósicas; papel y cartón	CARTAGENA	\$5.505	15,62%
900628930	LA HIPOTECARIA COMPAÑIA DE FINANCIAMIENTO S.A	Otras actividades de servicio financiero, excepto las de seguros y pensiones n.c.p.	BOGOTÁ	\$3.984	11,30%
800148119	GRASAS Y DERIVADOS SA GRADESA SA	Elaboración de aceites y grasas de origen vegetal refinados	MAGDALENA	\$1.385	3,93%
TOTAL				\$35.250	100,00%

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

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:

Medellín	Bogotá	Cali
Calle 7 sur # 42 - 70 Torre 2. Ed. Forum. Of 219 Teléfono: (604) 6040705	Cra 7 # 71 - 21. Edificio Avenida Chile Torre A. Piso 11 Teléfono: (601) 3905591	Calle 22N # 6A-N - 24 Ed. Santa Mónica Of 204 Teléfono: (602) 4950706

INFORME DE RIESGOS PÚBLICO FIC CREDIT OPPORTUNITIES FUND TÍTULOS VALORES

Tipo	Operaciones	Monto	COMPOSICION DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSION					
			A Sin Mora	B Entre 1 y 5 días	C Entre 6 y 20 días	D Entre 21 y 60 días	E Entre 61 y 90 días	F Más de 90 días
FACTURAS		57	13.507,07	13.507,07	0,00	0,00	0,00	0,00
DERECONOMICO		52	5.709,01	5.709,01	0,00	0,00	0,00	0,00
LIBRANZAS		38	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LETRES		44	58,23	58,23	0,00	0,00	0,00	0,00
Certificados de Depósito a Término		2	10.067,37	10.067,37	0,00	0,00	0,00	0,00
Títulos de tesorería TES pesos TF		2	5.908,00	5.908,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SIN MORA		195	\$ 35.249,67	\$ 35.249,67	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

* No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas). Actualmente el portafolio cuenta con un total de provisiones por valor de \$48.049,90 MM cuyos títulos están calificados en "F", lo anterior, teniendo en cuenta los flujos vigentes y vencidos del portafolio.

Información que permite 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.

EVOLUCIÓN DE PREPAGOS Y MORAS				
Año	Tipo	Prepagos	Mora	Al Tiempo
2020	FACTURAS	0,07%	3,04%	96,89%
2020	LETRES	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	LETRES	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	LETRES	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	LETRES	40,52%	42,83%	16,65%
2023	LIBRANZAS	100,00%	0,00%	0,00%
2023	PAGARES	80,66%	13,01%	6,35%
2024	CONTRATO	9,51%	39,31%	51,18%
2024	FACTURAS	25,22%	19,09%	55,69%
2024	LETRES	48,91%	37,47%	13,62%
2024	PAGARES	85,93%	8,44%	5,63%
2025	CONTRATO	72,59%	1,10%	26,30%
2025	FACTURAS	30,27%	23,89%	45,85%
2025	LETRES	69,73%	28,49%	1,77%
2025	PAGARES	93,74%	5,09%	1,17%