

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	36,68%
CUENTAS BANCARIAS	20,62%
DERECONOMICO	9,26%
Certificados de Depósito a Término	7,16%
LETRAS	0,08%
SIMULTANEA ACTIVA	26,20%
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 GEOGRAFICA	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
	PERSONAS NATURALES	Asalariados	BOGOTA	\$42	0,14%
890916911	INCOLMOTOS YAMAHA SA	Fabricación de motocicletas	GIRARDOTA	\$138	0,47%
805018495	CERDOS DEL VALLE S.A.	Cría de ganado porcino	CALI	\$5.174	17,60%
811022302	FEDERAL SAS	Elaboración de productos de molinería	ITAGUI	\$1.306	4,44%
900354302	INVERSIONES LA BUONA VITA SAS	Comercio al por mayor de productos alimenticios	ITAGUI	\$5.158	17,54%
890301960	CARVAJAL PULPA Y PAPEL S.A	Fabricación de pulpas (pastas) celulósicas; papel y cartón	CARTAGENA	\$4.984	16,95%
900628930	LA HIPOTECARIA COMPANIA DE FINANCIAMIENTO S.A	Otras actividades de servicio financiero, excepto las de seguros y pensiones n.c.p.	BOGOTÁ	\$3.959	13,46%
800148119	GRASAS Y DERIVADOS SA GRADESA SA	Elaboración de aceites y grasas de origen vegetal refinados	MAGDALENA	\$1.573	5,35%
899999115	EMPRESA DE TELECOMUNICACIONES DE BOGOTA SA ESP	Actividades de telecomunicaciones alámbricas	BOGOTÁ	\$4.790	16,29%
TOTAL				\$29.404	100,00%

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

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) 4850706

INFORME DE RIESGOS PÚBLICO FIC 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	69	20.281,43	20.281,43	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
DERECONOMICO	43	5.121,87	5.121,87	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LIBRANZAS	38	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LETRAS	35	42,23	42,23	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Certificados de Depósito a Término	1	3.958,64	3.958,64	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SIN MORA	186	\$ 29.404,17	\$ 29.404,17	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

* No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas). Actualmente el portafolio cuenta con un total de provisiones por valor de \$48,04 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	9,51%	39,31%	51,18%	
2024	FACTURAS	25,22%	19,09%	55,69%	
2024	LETRAS	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	LETRAS	69,73%	28,49%	1,77%	
2025	PAGARES	93,74%	5,09%	1,17%	
2026	CONTRATO	0,00%	0,00%	100,00%	
2026	FACTURAS	67,80%	7,06%	25,14%	
2026	LETRAS	78,51%	19,83%	1,67%	
2026	PAGARES	100,00%	0,00%	0,00%	

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

Calí

Calle 22N # 6AN - 24
Ed. Santa Mónica Of 204
Teléfono: (602) 4850706