

INFORME C.E 054 SFC

FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS VALORES

Composición del portafolio por tipo de inversión (CDTs, bonos, TES, cheques, libranzas, sentencias, entre otros) y la participación del mismo sobre el valor total del portafolio (en porcentajes).

COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN		
TIPO DE INVERSIÓN	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
PAGARES	13,799.93	35.73%
FACTURAS	10,361.38	26.83%
CDT	6,677.88	17.29%
CHEQUE	5,320.96	13.78%
TITULOS TES	1,248.07	3.23%
BONOS	919.05	2.38%
LIBRANZAS	295.35	0.76%
TOTAL	38,622.62	100.00%

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				
NOMBRE DEL PAGADOR	SECTOR ECONOMICO	UBICACIÓN GEOGRAFICA	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
GOBIERNO REPUBLICA DE COLOMBIA	NACION	CUNDINAMARCA	8,845.00	22.90%
SERFINDATA	OTRAS ACTIVIDADES DE SERVICIOS FINANCIEROS NCP	CUNDINAMARCA	7,219.99	18.69%
VEHIFINANZAS SAS	OTRAS ACTIVIDADES DE SERVICIOS FINANCIEROS NCP	CUNDINAMARCA	6,162.36	15.96%
PROFESIONALES DE FACTORING	OTRAS ACTIVIDADES DE SERVICIOS FINANCIEROS NCP	CUNDINAMARCA	5,115.48	13.24%
MERCADERIA SAS	COMERCIO	CUNDINAMARCA	3,662.58	9.48%
SUPERTIENDAS Y DROGUERIAS OLIMPICA SA	COMERCIO	CUNDINAMARCA	1,574.08	4.08%
COMCEL	TELECOMUNICACIONES	CUNDINAMARCA	1,435.22	3.72%
INTERNEXA	TELECOMUNICACIONES	CUNDINAMARCA	1,239.62	3.21%
ALMACENES EXITO SA	COMERCIO	CUNDINAMARCA	824.53	2.13%
ALMACENES LA 14 S A	COMERCIO	CUNDINAMARCA	560.93	1.45%
TELMEX	TELECOMUNICACIONES	CUNDINAMARCA	442.44	1.15%

INFORME C.E 054 SFC

FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS VALORES

SED META	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	META	388.23	1.01%
PROMOSUMMA SAS	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	ANTIOQUIA	374.27	0.97%
TUYA SA	COMERCIO	CUNDINAMARCA	357.25	0.92%
HACEB SA	TELECOMUNICACIONES	CUNDINAMARCA	181.68	0.47%
ALKOSTO S A	COMERCIO	CUNDINAMARCA	83.06	0.22%
COLPENSIONES	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	48.28	0.12%
SED PUTUMAYO	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	PUTUMAYO	35.36	0.09%
FOPEP	TRANSPORTE TERRESTRE, TRANSPORTE POR TUBERIAS	CUNDINAMARCA	27.65	0.07%
SED CHOCO	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CHOCO	11.33	0.03%
HUILA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	9.36	0.02%
FONDO DE PENSIONES PUBLICAS	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	8.42	0.02%
SURAMERICANA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	7.69	0.02%
SEDUCA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	4.75	0.01%
FIDUPREVISORA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	2.09	0.01%
POSITIVA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	1.01	0.00%
TOTAL			38,622.62	100.00%

INFORME C.E 054 SFC

FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS 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 párrafo 3 del numeral 6.4. Del Capítulo I-1 de la CBCF, como se indica en la tabla a continuación:

COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN								
TIPO DE OBLIGACION	No DE 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 - 90 DÍAS	MAS DE 90 DÍAS
PAGARES	7502	13,799.93		230.9	69.36			
FACTURAS	129	10,361.38		60.6				
CDT	8	6,677.88						
CHEQUE	2142	5,320.96		242.4				
TITULOS TES	2	1,248.07						
BONOS	1	919.05						
LIBRANZAS	53	295.35						

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 MORAS					
TIPO DE OBLIGACION	2018	2017	2016	2015	2014
CHEQUES	0.63%	50.8%	0.00%	0.00%	0.00%
CONTRATO	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
FACTURAS	0.16%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
LIBRANZAS	0.00%	0.00%	9.06%	0.94%	0.00%
PAGARES	0.78%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
BONO	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
CDT	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

EVOLUCION DE PREPAGOS					
TIPO DE OBLIGACION	2018	2017	2016	2015	2014
CHEQUES	0.30%	1.51%	35.70%	34.20%	16.70%
CONTRATO	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
FACTURAS	0.00%	0.00%	21.50%	16.20%	113.10%
LIBRANZAS	0.01%	0.09%	13.90%	25.30%	2.10%
PAGARES	0.00%	1.80%	71.20%	36.60%	4.20%
BONO	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
CDT	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%