

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 de este sobre el valor total del portafolio (en porcentajes).

COMPOSICIÓN DEL PORTAFOLIO POR TIPO DE INVERSIÓN		
TIPO DE INVERSIÓN	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
PAGARES	15,528	46%
CDT	7,181	21%
FACTURAS	5,317	16%
CHEQUE	3,000	9%
LIBRANZAS	2,518	8%
TOTAL	33,545	100%

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				
NOMBRE DEL PAGADOR	SECTOR ECONOMICO	UBICACIÓN GEOGRAFICA	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
SERFINDATA	ACTIVIDADES DE SERVICIOS FINANCIEROS, EXCEPTO LAS DE SEGUROS Y DE PENSIONES	CUNDINAMARCA	8,794.64	26.217%
GOBIERNO REPUBLICA DE COLOMBIA	FINANCIEROS	CUNDINAMARCA	7,181.19	21.408%
VEHIFINANZAS SAS	ACTIVIDADES DE SERVICIOS FINANCIEROS, EXCEPTO LAS DE SEGUROS Y DE PENSIONES	CUNDINAMARCA	5,663.79	16.884%
MERCADERIA	COMERCIO	CUNDINAMARCA	4,857.10	14.479%
PROFESIONALES DE FACTORING	ACTIVIDADES DE SERVICIOS FINANCIEROS, EXCEPTO LAS DE SEGUROS Y DE PENSIONES	CUNDINAMARCA	3,000.29	8.944%
PROMOSUMMA SAS	ACTIVIDADES DE SERVICIOS FINANCIEROS, EXCEPTO LAS DE SEGUROS Y DE PENSIONES	ANTIOQUIA	1,201.95	3.583%
COLPENSIONES	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	1,074.61	3.203%
FOPEP	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	474.60	1.415%
FIDUCIARIA CENTRAL	SECTOR REAL	CUNDINAMARCA	402.08	1.199%
CASUR	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	297.69	0.887%
SED PUTUMAYO	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	120.48	0.359%
FIDUPREVISORA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	61.21	0.182%
SECRETARIA DE EDUCACIÓN DEPARTAMENTAL DE CÓRDOBA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	58.22	0.174%
INTERNEXA	TELECOMUNICACIONES	CUNDINAMARCA	58.14	0.173%
SED CHOCO	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	53.44	0.159%

INFORME C.E 054 SFC
FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS
VALORES

SEDUCA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	48.04	0.143%
EDUCAME	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	34.78	0.104%
ALCALDIA DE MONTERIA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	31.50	0.094%
ALCALDIA DE BARRANQUILLA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	21.52	0.064%
ALCALDIA DE LORICA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	21.41	0.064%
SED META	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	20.74	0.062%
SED VAUPES	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	17.02	0.051%
SED YOPAL	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	12.72	0.038%
PROTECCION	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	10.66	0.032%
ALCALDIA DE MEDELLIN	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	6.47	0.019%
FONDO DE PENSIONES PUBLICAS	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	6.24	0.019%
SED DISTRITAL	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	6.18	0.018%
SURAMERICANA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	5.70	0.017%
SED. CUNDINAMARCA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	1.79	0.005%
POSITIVA	SEGUROS (INCLUSO EL REASEGURO), SEGUROS SOCIALES Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO LA SEGURIDAD SOCIAL	CUNDINAMARCA	0.75	0.002%
TOTAL			33,545	100.00%

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:

INFORME C.E 054 SFC
FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TITULOS
VALORES

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	4935	15,528	15,440	48	40			
CDT	16	7,181	5,678					
FACTURAS	274	5,317	3,403					
CHEQUE	1235	3,000	2,911	35	34	20	1	
LIBRANZAS	247	2,518	2,788					

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	0.27%	50.8%	0.00%	0.00%	0.00%
CONTRATO	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
FACTURAS	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
LIBRANZAS	0.00%	0.00%	9.06%	0.94%	0.00%
PAGARES	0.26%	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	0.00%	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	0.54%	0.09%	13.90%	25.30%	2.10%
PAGARES	0.00%	1.80%	71.20%	36.60%	4.20%
CDT	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%