

INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

FIC G.S. 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 TÍTULO	% DEL PORTAFOLIO
FACTURAS	33.21%
PAGARES	10.42%
CUENTAS BANCARIAS	36.97%
DERECONOMICO	8.86%
CDT	2.50%
LETRAS	8.05%
LIBRANZAS	0.00%
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 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 GEOGRÁFICA	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
MAKRO SUPERMAYORISTA SAS	Comercio al por mayor no especializado	BOGOTA	\$5,375.90	24.21%
PERSONAS NATURALES	Asalariados	BOGOTA	\$5,076.76	22.86%
KOBA COLOMBIA SAS	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	BOGOTA	\$2,954.05	13.30%
CIA GALLETAS NOEL	Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p.	MEDELLIN	\$1,984.19	8.94%
COMFENALCO VALLE DELAGENTE	Regulación de las actividades de organismos que prestan servicios de salud, educativos, culturales y otros servicios sociales, excepto servicios de seguridad social	CALI	\$1,423.53	6.41%
INGENIO LA CABANA SA	Elaboración y refinación de azúcar	CALI	\$1,258.92	5.67%
INCOLMOTOS YAMAHA SA	Fabricación de motocicletas	BOGOTA	\$1,123.28	5.06%
ARROZ FEDERAL SAS	Elaboración de productos de molinería	ITAGUI	\$834.92	3.76%
BBI COLOMBIA SAS	Expendio de comidas preparadas en cafeterías	FUNZA	\$732.28	3.30%
BCO. COLP. RED MUL	Bancos comerciales	BOGOTA	\$440.30	1.98%
BBVA COLOMBIA S.A	Bancos comerciales	BOGOTA	\$439.93	1.98%
CENCOSUD SA	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	BOGOTA	\$298.60	1.34%
MERCADERIA SAS	Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco	BOGOTA	\$126.73	0.57%
ALIMENTOS FINCA S.A.S.	Elaboración de alimentos preparados para animales	BOGOTA	\$66.87	0.30%
CONTEGRAL S.A.S.	Elaboración de alimentos preparados para animales	BOGOTA	\$43.14	0.19%
AVICOLA TRIPLE A S.A.S.	Cría de aves de corral	BOGOTA	\$20.40	0.09%
ESTRUMETALICAS JAMA SAS	Terminación y acabado de edificios y obras de ingeniería civil	BOGOTA	\$4.82	0.02%
TOTAL			\$22,204.63	100%

INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

FIC G.S. 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 párrafo 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	247	11,699.78	11,591.32	0.00	25.15	62.41	20.90	0.00
PAGARES	1871	3,669.84	3,666.74	3.10	0.00	0.00	0.00	0.00
DERECONOMICO	1553	3,119.50	2,799.37	21.53	0.00	0.00	298.60	0.00
LIBRANZAS	165	0.23	0.00	0.23	0.00	0.00	0.00	0.00
LETRAS	1902	2,835.05	2,826.37	8.68	0.00	0.00	0.00	0.00
CDT	2	880.23	880.23	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SIN MORA	5,740	\$ 22,204.63	\$ 21,764.03	\$ 33.53	\$ 25.15	\$ 62.41	\$ 319.50	\$ -

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

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	DERECONOMICO	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	DERECONOMICO	71.91%	26.31%	1.78%
2022	FACTURAS	41.05%	11.71%	47.24%
2022	LETRAS	23.21%	72.29%	4.50%
2022	LIBRANZAS	11.26%	88.74%	0.00%
2022	PAGARES	61.84%	34.30%	3.85%