

# 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 TITULO  | % DEL PORTAFOLIO |
| FACTURAS  | 36.83%           |
| PAGARES   | 10.28%           |
| CUENTAS BANCARIAS   | 20.74%           |
| DERECONOMICO  | 8.36%            |
| Certificados de Depósito a Término  | 2.86%            |
| Bonos emitidos por entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera | 3.39%            |
| Títulos de Tesorería - TES Pesos TF                                       | 1.65%            |
| LETRAS  | 8.50%            |
| LIBRANZAS   | 0.00%            |
| SIMULTANEA ACTIVA   | 7.39%            |
| <b>TOTAL</b>  | <b>100.00%</b>   |
| * 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.

# INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

## FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TÍTULOS VALORES

| 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               | \$5,441.25         | 25.34%           |
| PERSONAS NATURALES   | Asalariados  | BOGOTA               | \$4,545.69         | 21.17%           |
| KOBA COLOMBIA SAS  | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco | BOGOTA               | \$2,874.16         | 13.39%           |
| CIA GALLETAS NOEL  | Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p.   | MEDELLIN             | \$1,633.19         | 7.61%            |
| Caja de Compensación Familiar del Valle del Cauca - COMFENALCO VALLE DELAGENTE | Servicios de seguros sociales de salud y riesgos profesionales   | CALI                 | \$1,065.65         | 4.96%            |
| INCOLMOTOS YAMAHA SA   | Fabricación de motocicletas  | BOGOTA               | \$1,061.79         | 4.95%            |
| INGENIO LA CABANA SA   | Elaboración y refinación de azúcar   | CALI                 | \$1,028.40         | 4.79%            |
| Banco de Occidente   | Bancos comerciales   | CALI                 | \$1,013.34         | 4.72%            |
| FEDERAL SAS  | Elaboración de productos de molinería  | ITAGUI               | \$834.45           | 3.89%            |
| BBI COLOMBIA SAS   | Expendio de comidas preparadas en cafeterías   | TOCANCIPA            | \$530.76           | 2.47%            |
| GOBIERNO REPUBLICA DE COLOMBIA   | Banco Central  | BOGOTA               | \$492.38           | 2.29%            |
| BBVA COLOMBIA S.A  | Bancos comerciales   | BOGOTA               | \$428.50           | 2.00%            |
| BANCO COLPATRIA RED MULTIBANCA S.A   | Bancos comerciales   | BOGOTA               | \$425.33           | 1.98%            |
| ALIMENTOS FINCA S.A.S.   | Elaboración de alimentos preparados para animales  | ENVIGADO             | \$37.04            | 0.17%            |
| CONTEGRAL S.A.S.   | Elaboración de alimentos preparados para animales  | ENVIGADO             | \$27.79            | 0.13%            |
| MERCADERIA SAS   | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco | BOGOTA               | \$26.48            | 0.12%            |
| AVICOLA TRIPLE A S.A.S.  | Cría de aves de corral   | IBAGUE               | \$5.33             | 0.02%            |
| <b>TOTAL</b>   |  |                      | <b>\$21,471.52</b> | <b>100%</b>      |

\* 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 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  | 237          | 11,003.49           | 10,977.01           | 0.00             | 0.00              | 9.18               | 17.30              | 0.00           |
| PAGARES   | 1661         | 3,071.95            | 3,068.58            | 3.37             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| DERECONOMICO  | 1137         | 2,497.15            | 2,489.30            | 7.84             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| LIBRANZAS   | 155          | 0.06                | 0.00                | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 0.06               | 0.00           |
| LETRAS  | 1737         | 2,539.33            | 2,535.09            | 4.24             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| Certificados de Depósito a Término  | 2            | 853.83              | 853.83              | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| Bonos emitidos por entidades vigiladas por la Superintendencia Financiera | 1            | 1,013.34            | 1,013.34            | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| Títulos de tesorería TES pesos TF   | 1            | 492.38              | 492.38              | 0.00             | 0.00              | 0.00               | 0.00               | 0.00           |
| <b>SIN MORA</b>   | <b>4,931</b> | <b>\$ 21,471.52</b> | <b>\$ 21,429.53</b> | <b>\$ 15.46</b>  | <b>\$ -</b>       | <b>\$ 9.18</b>     | <b>\$ 17.35</b>    | <b>\$ -</b>    |

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

# INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

## FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TÍTULOS VALORES

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 | 68.57%   | 28.42%  | 3.01%     |
| 2022                          | FACTURAS     | 44.99%   | 9.71%   | 45.30%    |
| 2022                          | LETRAS       | 25.17%   | 69.75%  | 5.08%     |
| 2022                          | LIBRANZAS    | 11.31%   | 88.69%  | 0.00%     |
| 2022                          | PAGARES      | 59.61%   | 34.27%  | 6.12%     |