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	43.47%
PAGARES	7.23%
CUENTAS BANCARIAS	11.84%
CONTRATO	18.54%
Certificados de Depósito a Término	3.93%
LETRAS	9.77%
SIMULTANEA BONOS PENSIONALES	5.21%
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 GEOGRAFICA**	**VALOR ($ MM)**	**% DEL PORTAFOLIO**
MAKRO SUPERMAYORISTA SAS	Comercio al por mayor no especializado	BOGOTA	$4,337.53	24.60%
PERSONAS NATURALES	Asalariados	BOGOTA	$3,482.63	19.75%
CERDOS DEL VALLE S.A.	Cría de ganado porcino	CALI	$2,498.99	14.17%
LEVAPAN SA	Elaboración de productos lácteos	BOGOTA	$1,279.97	7.26%
CIA GALLETAS NOEL	Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p.	MEDELLIN	$1,089.89	6.18%
INCOLMOTOS YAMAHA SA	Fabricación de motocicletas	GIRARDOTA	$1,006.01	5.71%
ALMACENES FLAMINGO SA	Comercio al por menor en establecimientos no especializados, con surtido compuesto principalmente por productos diferentes de alimentos (víveres en general), bebidas y tabaco	MEDELLIN	$964.37	5.47%
FEDERAL SAS	Elaboración de productos de molinería	ITAGUI	$815.62	4.63%
OPERADORA AVICOLA COLOMBIA SAS	Procesamiento y conservación de carne y productos cárnicos	ENVIGADO	$671.12	3.81%
BCO. COLP. RED MUL	Bancos comerciales	BOGOTA	$424.27	2.41%
BBVA COLOMBIA S.A	Bancos comerciales	BOGOTA	$410.21	2.33%
UFINET COLOMBIA S.A.	Actividades de telecomunicaciones alámbricas	BOGOTA	$349.84	1.98%
BBI COLOMBIA SAS	Expendio de comidas preparadas en cafeterías	TOCANCIPA	$140.56	0.80%
Caja de Compensacion Familiar del Valle del Cauca - COMFENALCO VALLE DELAGENTE	Servicios de seguros sociales de salud y riesgos profesionales	CALI	$132.22	0.75%
CONTEGRAL S.A.S.	Elaboración de alimentos preparados para animales	ENVIGADO	$15.53	0.09%
ALIMENTOS FINCA S.A.S.	Elaboración de alimentos preparados para animales	ENVIGADO	$10.66	0.06%
AVICOLA TRIPLE A S.A.S.	Cría de aves de corral	IBAGUE	$2.77	0.02%
TOTAL			**$17,632.20**	**100%**
* 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 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	133	9,240.62	9,240.62	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
PAGARES	1144	1,537.73	1,535.17	2.56	0.00	0.00	0.00	0.00
CONTRATO	467	3,942.25	3,942.25	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	1383	2,077.11	2,068.90	8.21	0.00	0.00	0.00	0.00
Certificados de Depósito a Término	2	834.49	834.49	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SIN MORA	**3,167**	$ 17,632.20	$ 17,621.43	$ 10.77	$ -	$ -	$ -	$ -

* 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	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	27.31%	67.03%	5.66%
2022	LIBRANZAS	16.91%	83.09%	0.00%
2022	PAGARES	55.78%	35.32%	8.91%