

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	54.80%
PAGARES	5.62%
CUENTAS BANCARIAS	9.00%
CONTRATO	17.25%
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO A TÉRMINO	4.03%
LETRAS	8.63%
SIMULTANEA CONOS PENSIONALES	0.66%
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					
Nit Pagador	NOMBRE DEL PAGADOR	SECTOR ECONOMICO	UBICACIÓN GEOGRAFICA	VALOR (\$ MM)	% DEL PORTAFOLIO
900059238	MAKRO SUPERMAYORISTA SAS	Comercio al por mayor no especializado	BOGOTA	\$4,360.68	22.64%
	PERSONAS NATURALES	Asalariados	BOGOTA	\$3,036.54	15.77%
890914526	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	\$2,972.15	15.43%
805018495	CERDOS DEL VALLE S.A.	Cría de ganado porcino	CALI	\$2,508.05	13.02%
860000261	LEVAPAN SA	Elaboración de productos lácteos	BOGOTA	\$1,224.30	6.36%
890916911	INCOLMOTOS YAMAHA SA	Fabricación de motocicletas	GIRARDOTA	\$967.56	5.02%
811014994	CIA GALLETAS NOEL	Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p.	MEDELLIN	\$835.22	4.34%
811022302	FEDERAL SAS	Elaboración de productos de molinería	ITAGUI	\$764.45	3.97%
891401858	OPERADORA AVICOLA COLOMBIA SAS	Procesamiento y conservación de carne y productos cárnicos	ENVIGADO	\$641.42	3.33%
860029995	ACERIAS PAZ DEL RIO SA	Industrias básicas de hierro y de acero	BOGOTÁ	\$473.33	2.46%
860034594	BCO. COLP. RED MUL	Bancos comerciales	BOGOTA	\$436.78	2.27%
860003020	BBVA COLOMBIA S.A	Bancos comerciales	BOGOTA	\$423.49	2.20%
890903939	POSTOBON SA	Elaboración de bebidas no alcohólicas, producción de aguas minerales y de otras aguas embotelladas	MEDELLÍN	\$422.86	2.20%
860003831	PRODUCTOS RAMO SAS	Elaboración de productos de panadería	BOGOTÁ	\$112.04	0.58%
900860284	BBI COLOMBIA SAS	Expendio de comidas preparadas en cafeterías	TOCANCIPA	\$62.33	0.32%
890901271	CONTEGRAL S.A.S.	Elaboración de alimentos preparados para animales	ENVIGADO	\$10.31	0.05%
860004828	ALIMENTOS FINCA S.A.S.	Elaboración de alimentos preparados para animales	ENVIGADO	\$6.47	0.03%
900294923	AVICOLA TRIPLE A S.A.S.	Cría de aves de corral	IBAGUE	\$1.68	0.01%
TOTAL				\$19,259.67	100%
* 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

INFORME DE RIESGOS PÚBLICO

FIC G.S. CREDIT OPPORTUNITIES FUND TÍTULOS VALORES

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	146	11,684.33	11,684.33	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
PAGARES	967	1,197.18	1,197.18	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
CONTRATO	311	3,678.52	3,678.52	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	1206	1,839.36	1,609.38	229.98	0.00	0.00	0.00	0.00
Certificados de Depósito a Término	2	860.28	860.28	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SIN MORA	2,670	\$ 19,259.67	\$ 19,029.69	\$ 229.98	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

* No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas). Actualmente el portafolio cuenta con un total de provisiones por valor de 2375.28 MM cuyos títulos tienen calificación "F". Lo anterior, teniendo en cuenta los flujos vigentes y vencidos del portafolio.

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%
2023	CONTRATO	0.00%	26.96%	73.04%
2023	FACTURAS	42.92%	25.03%	32.05%
2023	LETRAS	31.42%	61.06%	7.52%
2023	LIBRANZAS	100.00%	0.00%	0.00%
2023	PAGARES	76.93%	20.68%	2.40%