

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 | 48.35% |
| PAGARES | 4.97% |
| CUENTAS BANCARIAS | 18.00% |
| DERECONOMICO | 16.52% |
| Certificados de Depósito a Término | 4.20% |
| LETRAS | 7.96% |
| 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 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.

| 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 | \$4,046.16 | 22.85% |
| 805018495 | CERDOS DEL VALLE S.A. | Cría de ganado porcino | CALI | \$3,030.40 | 17.11% |
| | PERSONAS NATURALES | Asalariados | BOGOTA | \$2,792.58 | 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 | \$1,319.53 | 7.45% |
| 860000261 | LEVAPAN SA | Elaboración de productos lácteos | BOGOTA | \$1,196.76 | 6.76% |
| 890916911 | INCOLMOTOS YAMAHA SA | Fabricación de motocicletas | GIRARDOTA | \$948.61 | 5.36% |
| 811022302 | FEDERAL SAS | Elaboración de productos de molinería | ITAGUI | \$745.05 | 4.21% |
| 891401858 | OPERADORA AVICOLA COLOMBIA SAS | Procesamiento y conservación de carne y productos cárnicos | ENVIGADO | \$626.70 | 3.54% |
| 811014994 | CIA GALLETAS NOEL | Elaboración de otros productos alimenticios n.c.p. | MEDELLIN | \$564.56 | 3.19% |
| 860029995 | ACERIAS PAZ DEL RIO SA | Industrias básicas de hierro y de acero | BOGOTÁ | \$481.39 | 2.72% |
| 860034594 | BCO. COLP. RED MUL | Bancos comerciales | BOGOTA | \$456.93 | 2.58% |
| 860003020 | BBVA COLOMBIA S.A | Bancos comerciales | BOGOTA | \$449.96 | 2.54% |
| 890900043 | COMPAÑIA COLOMBIANA DE TABACO | Comercio al por mayor de bebidas y tabaco | MEDELLÍN | \$366.61 | 2.07% |
| 900354302 | INVERSIONES LA BUONA VITA SAS | Comercio al por mayor de productos alimenticios | ITAGUI | \$263.63 | 1.49% |
| 860008448 | MEALS MERCADEO DE ALIMENTOS DE COLOMBIA SAS | Comercio al por mayor de productos alimenticios | BOGOTÁ | \$231.63 | 1.31% |
| 900276962 | KOBA COLOMBIA SAS | Comercio al por menor en establecimientos no especializados con surtido compuesto principalmente por alimentos, bebidas o tabaco | BOGOTA | \$139.32 | 0.79% |
| 900860284 | BBI COLOMBIA SAS | Expendio de comidas preparadas en cafeterías | TOCANCIPA | \$37.56 | 0.21% |
| 890901271 | CONTEGRAL S.A.S. | Elaboración de alimentos preparados para animales | ENVIGADO | \$7.66 | 0.04% |
| 860004828 | ALIMENTOS FINCA S.A.S. | Elaboración de alimentos preparados para animales | ENVIGADO | \$4.34 | 0.02% |
| 900294923 | AVICOLA TRIPLE A S.A.S. | Cría de aves de corral | IBAGUE | \$1.13 | 0.01% |
| | TOTAL | | | \$17,710.51 | 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 | 147 | 10,443.23 | 9,554.92 | 888.31 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| PAGARES | 864 | 1,073.25 | 1,073.25 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| CONTRATO | 259 | 3,567.81 | 3,567.81 | 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 | 1123 | 1,719.34 | 1,667.55 | 51.79 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Certificados de Depósito a Término | 2 | 906.89 | 906.89 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| SIN MORA | 2,433 | \$ 17,710.51 | \$ 16,770.42 | \$ 940.10 | \$ - | \$ - | \$ - | \$ - |

* No se incluyen cuentas de ahorros ni operaciones de liquidez (operaciones simultaneas). Actualmente el portafolio cuenta con un total de 2372 MM cuyo vencimiento fue hace más de 90 días, sin embargo, esta cartera se encuentra deteriorada al 100%

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% | 23.59% | 76.41% |
| 2023 | FACTURAS | 19.64% | 37.96% | 42.40% |
| 2023 | LETRAS | 31.48% | 57.84% | 10.68% |
| 2023 | LIBRANZAS | 100.00% | 0.00% | 0.00% |
| 2023 | PAGARES | 76.55% | 20.13% | 3.32% |