

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

CARTA CIRCULAR 12 DE 2017
(Enero 25)

Señores

REPRESENTANTES LEGALES DE LAS SOCIEDADES ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE PENSIONES Y DE CESANTIAS.

Referencia: Variación del portafolio de referencia el 2 de enero de 2017

Apreciados señores:

De acuerdo con lo dispuesto en el numeral 2.5, Capítulo II, Título III de la Parte II de la Circular Básica Jurídica, tratándose de los tipos de fondos de pensiones obligatorias, y el numeral 1.10, Capítulo III, Título III de la Parte II de la citada Circular, en el caso del portafolio de largo plazo de los fondos de cesantía, el 2 de enero de 2017 la composición de los portafolios de referencia de los tipos de fondos de pensiones obligatorias y del portafolio de largo plazo del fondo de cesantía, presentaron las siguientes modificaciones:

VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES

CLASE DE TITULO	VENCIMIENTO	FECHA DE COMPRA	VALOR NOMINAL \$	TASA NOMINAL%	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$	PORTAFOLIO LARGO PLAZO FONDO DE CESANTIA \$
CDT	Capital e Intereses	01/09/2016	6.135	7.8942 P V		6.377
CDT	Capital e Intereses	01/09/2016	200.000	8.3182 P V		205.592
BONO	Intereses	14/12/2011	1.445	IPC+6.10 T V	43,29	
VALOR A INVERTIR POR VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES (A)					43,29	205.592

INCREMENTO (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (B)	7.663	(267.567)
--	-------	-----------

PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION DE DICIEMBRE DE 2016 Y CUATRO POR MIL DE ENERO DE 2017 (C)		34.498
---	--	--------

TITULOS EXCLUIDOS						
CLASE DE TITULO	FECHA DE COMPRA	FECHA DE VENCIMIENTO	VALOR NOMINAL \$	TASA NOMINAL%	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$	PORTAFOLIO LARGO PLAZO FONDO DE CESANTIA \$
TES	02/11/2009	24/10/2018	92.100	11,25 A V		101,499
TÍTULOS A EXCLUIR (D)						101,499

VALOR A INVERTIR EL 2 DE ENERO DE 2017 (A+B-C+D)	7.706,29	11.403
--	----------	--------

INVERSIONES EFECTUADAS EL 2 DE ENERO DE 2017							
CLASE DE TITULO	FECHA DE VENCIMIENTO	TASA NOMINAL %	TIR DE COMPRA E.A. %	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$		PORTAFOLIO LARGO PLAZO FONDO DE CESANTIA \$	
				VALOR COMPRA	VALOR NOMINAL	VALOR COMPRA	VALOR NOMINAL
CDT (1) BONO(2)	03/04/2017 07/05/2020	2.967 P V 7.50 T V	3.04 7.28	7.706,29	4.780	11.403	11.403
TOTAL INVERTIDO				7.706,29	4.780	11.403	11.403

(1) Tasa de captación en Bancos con calificación 1+; (2) Calificado AAA.

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

De otra parte, este Despacho se permite informar que del 5 al 30 de diciembre de 2016, se presentaron las siguientes modificaciones:

CLASE DE TITULO	FECHA DE VENCIMIENTO	CONCEPTO	FECHA DE COMPRA	VALOR NOMINAL \$	TASA NOMINAL %		FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$	PORTAFOLIO LARGO PLAZO FONDO DE CESANTIA \$
CDT	06/12/2016	Capital e Intereses	05/09/2016	4,086	8.0544	P.V.		4,169
BONO	06/12/2016	Intereses	01/09/2016	190,600	IPC+3.87	T.V.		4,849
BONO	12/12/2016	Intereses	03/09/2012	270,000	IPC+3.88	T.V.		7,919
BONO	12/12/2016	Intereses	01/09/2014	285,700	IPC+4.19	T.V.		8,598
BONO	12/12/2016	Intereses	02/09/2013	256,000	IPC+3.88	T.V.		7,509
BONO	12/12/2016	Intereses	01/09/2015	233,640	IPC+4.25	T.V.		5,869
BONO	12/12/2016	Intereses	23/11/2015	306,570	IPC+3.1	T.V.		6,833
BONO	12/12/2016	Intereses	01/09/2015	57,700	IPC+3.1	T.V.		1,286
CDT	13/12/2016	Capital e Intereses	13/09/2016	77,532	7.6762	P.V.		79,020
CDT	22/12/2016	Capital e Intereses	22/09/2016	8,567	7.7706	P.V.		8,733
CDT	26/12/2016	Capital e Intereses	13/06/1901	60,989	8.2	P.V.		63,073
BONO	26/12/2016	Intereses	02/05/1900	243,100	3.53	T.V.		5,677
CDT	27/12/2016	Capital e Intereses	13/06/1901	34,870	7.723	P.V.		35,543
CDT	28/12/2016	Capital e Intereses	13/06/1901	14,564	7.629	P.V.		14,842
CDT	30/12/2016	Capital e Intereses	30/06/2016	6,135	7.8942	P.V.		6,377
BONO	05/12/2016	Intereses	10/12/2013	1,701	IPC+5.2	T.V.	48.81	
BONO	05/12/2016	Intereses	01/10/2012	4,555	IPC+4.84	T.V.	126.71	
BONO	05/12/2016	Intereses	01/11/2012	4,297	IPC+4.84	T.V.	119.53	
BONO	05/12/2016	Intereses	27/11/2012	1,565	IPC+4.84	T.V.	43.53	
BONO	05/12/2016	Intereses	14/03/2016	2,174	IPC+4.84	T.V.	60.48	
BONO	05/12/2016	Capital e Intereses	01/02/2013	3,674	IPC+4.49	T.V.	3,794.86	
BONO	06/12/2016	Intereses	24/02/2016	8,840	IPC+4.02	T.V.	228.14	
BONO	06/12/2016	Intereses	01/09/2016	5,453	IPC+3.87	T.V.	138.72	
BONO	06/12/2016	Intereses	14/09/2016	2,382	IPC+4.02	T.V.	61.47	
BONO	06/12/2016	Intereses	03/10/2016	5,742	IPC+3.87	T.V.	146.07	
BONO	06/12/2016	Intereses	21/01/2016	2,180	IPC+3.87	T.V.	55.46	
BONO	06/12/2016	Intereses	22/02/2016	1,908	IPC+4.02	T.V.	49.25	
BONO	06/12/2016	Intereses	21/10/2015	1,982	IPC+3.87	T.V.	50.42	
BONO	06/12/2016	Intereses	27/05/2016	2,903	IPC+3.87	T.V.	73.85	
BONO	06/12/2016	Intereses	02/03/2015	5,025	IPC+4.02	T.V.	129.68	
BONO	06/12/2016	Intereses	21/05/2015	1,760	IPC+3.87	T.V.	44.78	
BONO	06/12/2016	Intereses	21/11/2011	1,770	IPC+5.8	T.V.	60.25	
BONO	12/12/2016	Intereses	17/05/2013	2,947	IPC+4.19	T.V.	88.68	
BONO	12/12/2016	Intereses	01/09/2011	78,360	IPC+4.23	T.V.	2,366.01	
BONO	12/12/2016	Intereses	21/11/2013	1,939	IPC+4.19	T.V.	58.36	
BONO	12/12/2016	Intereses	01/03/2012	4,977	IPC+4.23	T.V.	150.28	
BONO	12/12/2016	Intereses	19/12/2011	118	IPC+3.88	T.V.	3.47	
BONO	12/12/2016	Intereses	30/12/2011	1	IPC+4.19	T.V.	0.03	
BONO	12/12/2016	Intereses	24/07/2012	20,920	IPC+4.19	T.V.	629.60	

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Carta Circular 12 de 2017

Página 4

INVERSIONES EFECTUADAS										
CLASE DE TITULO	FECHA DE INVERSION	FECHA DE VENCIMIENTO	TASA NOMINAL %			TIR DE COMPRA E.A %.	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$		PORTAFOLIO LARGO PLAZO FONDO DE CESANTIA \$	
						VALOR COMPRA	VALOR NOMINAL	VALOR COMPRA	VALOR NOMINAL	
CDT (1)	06/12/2016	06/03/2017	7.7706	P	V	8.116			9,018	9,018
CDT (1)	12/12/2016	13/03/2017	7.677	P	V	8.014			38,014	38,014
CDT (1)	13/12/2016	13/03/2017	7.5817	P	V	7.912			79,020	79,020
CDT (1)	22/12/2016	22/05/2017	7.7252	P	V	7.959			8,733	8,733
CDT (1)	26/12/2016	27/03/2017	7.393	P	V	7.709			68,750	68,750
CDT (1)	27/12/2016	03/04/2017	7.9173	P	V	8.179			35,543	35,543
CDT (1)	28/12/2016	28/06/2017	7.6054	P	V	7.772			14,842	14,842
BONO (2)	05/12/2016	02/11/2026	IPC+4.62	T	V	10.417	4,193.92	3,933.00		
TES	06/12/2016	21/11/2018	5	A	V	6.475	1,038.09	1,064.00		
BONO (2)	12/12/2016	15/11/2018	IPC+3.92	T	V	8.799	5,335.21	5,186.00		
BONO (2)	14/12/2016	10/03/2021	IPC+4.19	T	V	9.722	2,027.92	1,982.50		
TES	15/12/2016	21/11/2018	5	A	V	6.504	77.41	79.26		
TES	19/12/2016	21/11/2018	5	A	V	6.513	185.80	190.14		
TES	22/12/2016	21/11/2018	5	A	V	6.214	384.09	390.80		
TOTAL INVERTIDO							13,242.44	12,825.70	253,920	253,920

(1) Tasa de captación en Bancos con calificación 1+; (2) Calificado AAA.

Atentamente,

JUAN CARLOS BONILLA B.
Superintendente Delegado para Pensiones,
Cesantías y Fiduciarias

121000