

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

CARTA CIRCULAR 21 DE 2017
(Febrero 17)

Señores

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

Referencia: Variación del portafolio de referencia el 1 de febrero 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 1 de febrero 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	01/11/2016	3.232	7.582 P V		3.293
VALOR A INVERTIR POR VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES (A)						3.293

INCREMENTO (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (B)	7.009	(268.604)
--	-------	-----------

PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION DE ENERO Y CUATRO POR MIL DE FEBRERO DE 2017 (C)		34.076
---	--	--------

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	18/01/2017	21/11/2018	21.711	5 A V		21.455
TES	01/09/2015	11/09/2019	275.670	7 A V		286.989
TÍTULOS A EXCLUIR (D)						308,444

VALOR A INVERTIR EL1 DE FEBRERO DE 2017 (A+B-C+D)	7.009	9.057
---	-------	-------

INVERSIONES EFECTUADAS EL 1 DE FEBRERO 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)	02/05/2017 27/02/2023	7.4879 P V IPC+3.09 T V	7.90 9.40	7.009	7.003	9.057	9.057
TOTAL INVERTIDO				7.009	7.003	9.057	9.057

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

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Carta Circular 21 de 2017

Página 2

De otra parte, este Despacho se permite informar que del 10 al 30 de enero de 2017, 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	11/01/2017	Capital e Intereses	11/07/2016	168,144.00	8.1826	PV		175,023
CDT	18/01/2017	Capital e Intereses	18/10/2016	21,065.00	7.77	PV		21,474
BONO	10/01/2017	Intereses	27/05/2015	2,082.82	IPC+3.25	TV	54.33	
BONO	10/01/2017	Intereses	14/12/2015	2,128.00	IPC+3.96	TV	59.28	
BONO	23/01/2017	Intereses	02/05/2012	3,715.00	IPC+4.58	TV	109.22	
BONO	23/01/2017	Intereses	27/05/2013	1,328.00	IPC+4.58	TV	39.04	
BONO	23/01/2017	Intereses	21/11/2012	1,881.70	IPC+4.58	TV	55.32	
BONO	23/01/2017	Intereses	01/09/2011	74,280.00	IPC+5.05	TV	2,270.32	
BONO	23/01/2017	Intereses	28/11/2011	1,218.00	IPC+6.08	TV	40.32	
BONO	23/01/2017	Intereses	02/12/2013	4,559.00	IPC+5.05	TV	139.34	
BONO	23/01/2017	Intereses	03/06/2014	5,486.70	IPC+5.89	TV	179.06	
BONO	25/01/2017	Capital e Intereses	03/07/2012	3,491.78	IPC+3.9	TV	3,588.53	
BONO	26/01/2017	Intereses	23/01/2017	2,695.00	IPC+3.9	TV	74.68	
BONO	27/01/2017	Intereses	21/10/2013	1,468.50	IPC+4.25	TV	36.55	
BONO	27/01/2017	Intereses	21/04/2016	2,401.00	IPC+4.25	TV	59.75	
BONO	27/01/2017	Intereses	23/04/2012	1,575.80	IPC+4.05	TV	38.44	
BONO	27/01/2017	Intereses	01/02/2012	3,820.00	IPC+4.25	TV	95.07	
BONO	27/01/2017	Intereses	21/10/2011	1,471.00	IPC+4.6	TV	37.88	
BONO	30/01/2017	Intereses	01/04/2016	6,457.00	IPC+3.64	TV	174.73	
BONO	30/01/2017	Intereses	21/05/2013	1,858.00	IPC+3.05	TV	47.53	
VALOR A INVERTIR							7,099.39	196,497

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	
CDT (1)	11/01/2017	11/07/2017	7.5572	P	V	7.766			175,023
TES	18/01/2017	21/11/2018	5	A	V	6.102			21,474
TES	10/01/2017	21/11/2018	5	A	V	5.969	113.61	114.75	
TES	26/01/2017	21/11/2018	5	A	V	6.129	74.68	75.44	
TES	27/01/2017	21/11/2018	5	A	V	6.103	267.69	270.25	
TES	30/01/2017	21/11/2018	5	A	V	6.05	222.26	224.08	
BONO (2)	23/01/2017	26/10/2028	IPC+3.90%	T	V	9.512	2,832.62	2,695.00	
BONO (2)	25/01/2017	22/06/2020	IPC+3.39%	T	V	8.73	3,588.53	3,500.00	
TOTAL INVERTIDO							7,099.39	6,879.52	196,497

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

Atentamente,

LUIS FELIPE JIMENEZ SALAZAR
Superintendente Delegado para Pensiones (E)
411000