

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

CARTA CIRCULAR 28 DE 2017
(Marzo 17)

Señores

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

Referencia: Variación del portafolio de referencia el 1 de marzo 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 marzo 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	3.232	8.3267 P V		208.327
VALOR A INVERTIR POR VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES (A)						208.327

INCREMENTO (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (B)	10.958,96	(239.578)
--	-----------	-----------

PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION DE FEBRERO Y CUATRO POR MIL DE MARZO DE 2017 (C)		30.455
---	--	--------

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 \$
BONO	03/09/2012	22/09/2018	70.000	IPC+4.20 T V		75.383
TÍTULOS A EXCLUIR (D)						75.383

VALOR A INVERTIR EL1 DE MARZO DE 2017 (A+B-C+D)	10.958,96	13.677
---	-----------	--------

INVERSIONES EFECTUADAS EL 1 DE MARZO 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) TES	01/09/2017 04/04/2035	7.2197 P V 4.75 A V	7.29 3.71	10.958,96 (2)	10.856,13 (3)	13.677	13.677
TOTAL INVERTIDO				10.958,96	10.856,13	13.677	13.677

(1) Tasa de captación en Bancos con calificación 1+; (2) 44,76 UVR. (3) 44,34 UVR.

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Carta Circular 28 de 2017

Página 2

De otra parte, este Despacho se permite informar que del 2 al 28 de febrero 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 \$
BONO	02/02/2017	Intereses	02/09/2013	223,140.00	IPC +4.45	TV		5,664.00
CDT	02/02/2017	Capital e Intereses	02/11/2016	6,488.00	7.582	PV		6,611.00
CDT	03/02/2017	Capital e Intereses	03/10/2016	6,143.00	7.80	PV		6,303.00
BONO	07/02/2017	Capital e Intereses	01/09/2016	196,770.00	IPC +3.24	TV		4,268.00
BONO	16/02/2017	Capital e Intereses	01/09/2014	230,770.00	IPC +3.42	TV		5,110.00
BONO	16/02/2017	Capital e Intereses	12/09/2016	121,385.00	IPC +3.42	TV		2,688.00
CDT	16/02/2017	Capital e Intereses	16/11/2016	28,956.00	7.7706	PV		29,519.00
BONO	21/02/2017	Capital e Intereses	01/09/2015	240,900.00	IPC +3.89	TV		6,208.00
BONO	21/02/2017	Capital e Intereses	01/09/2016	186,800.00	IPC +6.39	TV		5,966.00
CDT	21/02/2017	Capital e Intereses	21/11/2016	17,198.00	7.7706	PV		17,532.00
CDT	22/02/2017	Capital e Intereses	22/11/2016	7,192.00	7.865	PV		7,333.00
BONO	27/02/2017	Capital e Intereses	01/09/2016	199,400.00	IPC +3.14	TV		4,766.00
BONO	02/02/2017	Intereses	01/09/2014	6,223.00	IPC +4.62	TV	160.57	
BONO	02/02/2017	Intereses	06/09/2016	995.30	IPC +4.10	TV	24.40	
BONO	02/02/2017	Intereses	05/12/2016	3,933.00	IPC +4.62	TV	101.48	
BONO	03/02/2017	Intereses	27/02/2015	1,866.68	IPC +4.35	TV	46.92	
BONO	03/02/2017	Intereses	27/08/2015	2,329.15	IPC +4.35	TV	58.54	
BONO	03/02/2017	Intereses	10/06/2016	3,454.00	IPC +4.35	TV	86.82	
BONO	07/02/2017	Intereses	20/01/2015	4,737.50	IPC +3.80	TV	109.37	
BONO	07/02/2017	Intereses	29/08/2016	3,327.00	IPC +3.24	TV	72.17	
BONO	07/02/2017	Intereses	02/01/2017	7,486.00	IPC +3.55	TV	186.58	
BONO	08/02/2017	Intereses	07/09/2015	2,146.00	IPC +4.00	TV	55.89	
BONO	08/02/2017	Intereses	10/12/2015	2,777.10	IPC +4.00	TV	72.33	
BONO	08/02/2017	Intereses	11/03/2016	1,315.00	IPC +4.00	TV	34.25	
BONO	09/02/2017	Intereses	14/03/2014	1,433.39	IPC +4.27	TV	38.29	
BONO	13/02/2017	Intereses	11/09/2015	2,292.00	IPC +3.25	TV	55.41	
BONO	13/02/2017	Intereses	10/03/2016	4,557.00	IPC +3.49	TV	101.69	
BONO	13/02/2017	Intereses	21/07/2016	2,842.00	IPC +3.25	TV	68.71	
BONO	15/02/2017	Intereses	10/06/2014	1,758.80	IPC +4.23	TV	46.81	
BONO	15/02/2017	Intereses	10/12/2014	1,924.00	IPC +4.23	TV	51.21	
BONO	15/02/2017	Intereses	21/10/2016	2,829.00	IPC +3.89	TV	72.91	
BONO	15/02/2017	Intereses	12/12/2016	5,186.00	IPC +3.92	TV	121.27	
BONO	16/02/2017	Intereses	21/07/2014	1,588.87	IPC +3.42	TV	35.18	
BONO	16/02/2017	Intereses	15/09/2014	1,495.15	IPC +3.42	TV	33.10	
BONO	16/02/2017	Intereses	21/07/2015	2,022.90	IPC +3.42	TV	44.79	
BONO	16/02/2017	Intereses	02/11/2015	5,854.00	IPC +3.42	TV	129.61	
BONO	16/02/2017	Intereses	01/06/2016	3,574.00	IPC +3.42	TV	79.13	
BONO	16/02/2017	Intereses	12/09/2016	7,148.34	IPC +3.42	TV	158.27	
BONO	17/02/2017	Intereses	10/09/2015	2,529.20	IPC +2.44	TV	56.01	
BONO	20/02/2017	Intereses	23/05/2016	1,812.00	IPC +4.65	TV	50.12	
BONO	21/02/2017	Intereses	01/09/2011	61,120.00	12.59	TV	1,939.58	
TES	23/02/2017	Intereses	01/09/2011	819.84	4.75	AV	9,510.04	

CLASE DE TITULO	FECHA DE VENCIMIENTO	CONCEPTO	FECHA DE COMPRA	VALOR NOMINAL \$	TASA NOMINAL %		FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$	PORTAFOLIO LARGO PLAZO FONDO DE CESANTIA \$
TES	23/02/2017	Intereses	24/10/2011	34.40	4.75	AV	399.03	
BONO	27/02/2017	Intereses	01/09/2011	73,200.00	IPC +5.40	TV	2,160.04	
BONO	27/02/2017	Intereses	02/01/2012	5,417.00	IPC +5.99	TV	167.70	
BONO	27/02/2017	Intereses	01/04/2014	6,674.00	IPC +3.09	TV	158.67	
BONO	27/02/2017	Intereses	21/05/2014	1,953.40	IPC +3.09	TV	46.44	
BONO	27/02/2017	Intereses	21/08/2014	1,651.00	IPC +5.90	TV	50.75	
BONO	27/02/2017	Intereses	15/12/2014	1,419.20	IPC +7.00	TV	47.44	
BONO	27/02/2017	Intereses	09/03/2015	8,360.00	IPC +3.09	TV	198.76	
BONO	27/02/2017	Intereses	21/04/2015	1,788.40	IPC +3.14	TV	42.74	
BONO	27/02/2017	Intereses	10/06/2015	2,525.00	IPC +3.09	TV	60.03	
BONO	27/02/2017	Intereses	21/08/2015	1,903.40	IPC +3.14	TV	45.49	
BONO	27/02/2017	Intereses	14/06/2016	2,291.00	IPC +5.69	TV	63.58	
BONO	27/02/2017	Intereses	01/07/2016	4,783.00	IPC +5.69	TV	132.73	
BONO	27/02/2017	Intereses	22/09/2016	1,584.00	IPC +5.69	TV	43.96	
BONO	27/02/2017	Intereses	01/02/2017	7,003.00	IPC +3.09	TV	166.49	
BONO	27/02/2017	Intereses	03/03/2014	8,105.00	5.65	TV	115.42	
BONO	28/02/2017	Intereses	03/08/2015	5,526.00	IPC +2.90	TV	127.33	
VALOR A INVERTIR							17,628.05	101,968.00

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)	02/02/2017	02/05/2017	7.3925	P	V	7.7995		12,275.00	12,275.00
CDT (1)	03/02/2017	03/05/2017	7.35	P	V	7.7535		6,303.00	6,303.00
CDT (1)	07/02/2017	08/08/2017	7.413	P	V	7.6146		4,268.00	4,268.00
CDT (1)	16/02/2017	16/05/2017	7.3925	P	V	7.7994		37,317.00	37,317.00
CDT (1)	21/02/2017	22/05/2017	7.393	P	V	7.7981		29,706.00	29,706.00
CDT (1)	22/02/2017	22/08/2017	7.5572	P	V	7.7661		7,333.00	7,333.00
CDT (1)	27/02/2017	28/08/2017	7.4616	P	V	7.6657		4,766.00	4,766.00
TES	02/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.2894	286.45	289.80	
TES	03/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.2437	192.28	194.35	
TES	07/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.2871	368.12	372.10	
TES	08/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.2688	162.47	164.15	
TES	09/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.2696	38.29	38.68	
TES	13/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.2972	225.81	228.06	
TES	15/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.3281	292.20	295.16	
TES	16/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.3778	480.08	485.25	
TES	17/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.3848	56.01	56.61	
TES	20/02/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.4451	50.12	50.68	

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Carta Circular 28 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	
BONO (2)	21/02/2017	08/05/2021	IPC+ 3.70 T V	8.6469	1,939.58	1,889.00			
TES UVR	23/02/2017	10/03/2021	3.50 A V	2.6653	9,909.07 (3)	9,303.19 (4)			
BONO (2)	27/02/2017	18/03/2020	IPC+ 2.99 T V	8.5125	3,500.24	3,431.00			
TES	28/02/2017	21/11/2018	5.00 A V	6.1510	127.33	127.98			
TOTAL INVERTIDO					17,628.05	16,926.01	101,968.00	101,968.00	

(1) Tasa de captación en Bancos con calificación 1+; (2) Calificado AAA.; (3) 40.56 UVR y (4) 38.08 UVR.

Atentamente,

LUIS FELIPE JIMENEZ SALAZAR
Superintendente Delegado para Pensiones.

411000