



SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

CARTA CIRCULAR 06 DE 2019
(Enero 18)

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 2019

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 2019 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 \$
BONO	Intereses	14/12/2011	1,445	IPC+6.10 T V	33.67	
VALOR A INVERTIR POR VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES (A)					33.67	
INCREMENTO (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (B)					5,009	(431,650)
PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION DE DICIEMBRE DE 2018 Y CUATRO POR MIL DE ENERO DE 2019 (C)						41,860
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	1/09/2016	10/03/2021	809.30	3.50 A V		225,584
TES	1/09/2016	10/03/2021	809.30	3.50 A V		225,584
CDT	11/12/2018	11/04/2019	4,339.00	4.8700 P V		4,352
CDT	26/10/2018	28/01/2019	18,659.00	4.7166 P V		18,820
TÍTULOS A EXCLUIR (D)						474,340



SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

VALOR A INVERTIR EL 2 DE ENERO DE 2019 (A+B-C+D)	5,042.67	830
--	----------	-----

INVERSIONES EFECTUADAS EL 2 DE ENERO DE 2019								
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	03/04/2019	4.4260	P V	4.56			830	830
BONO	29/01/2033	IPC+3.64	T V	7.67	5,042.67	5,172.00		
TOTAL INVERTIDO					5,042.67	5,172.00	830	830

Carta Circular 06 2019

Página 2

De otra parte, este Despacho se permite informar que, del 5 al 26 de diciembre de 2018, 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	5/12/2018	Capital e Intereses	5/09/2018	24,309.00	4.5227	P.V.		24,584
CDT	6/12/2018	Capital e Intereses	6/09/2018	12,268.00	4.9571	P.V.		12,420
BONO	6/12/2018	Intereses	12/03/2018	450,000.00	IPC+3.87	T.V.		8,006
BONO	6/12/2018	Intereses	22/08/2017	60,548.00	IPC+4.02	T.V.		1,099
BONO	10/12/2018	Intereses	1/09/2014	285,700.00	IPC+4.19	T.V.		5,144
BONO	11/12/2018	Intereses	1/09/2015	233,640.00	IPC+4.25	T.V.		4,339
CDT	12/12/2018	Capital e Intereses	12/09/2018	14,679.00	4.3780	P.V.		14,840
CDT	13/12/2018	Capital e Intereses	13/09/2018	9,408.00	4.5710	P.V.		9,516
CDT	20/12/2018	Capital e Intereses	24/09/2018	4,589.00	4.8015	P.V.		4,642
BONO	24/12/2018	Intereses	1/09/2017	280,200.00	IPC+3.39	T.V.		4,497
BONO	26/12/2018	Intereses	1/09/2015	243,100.00	IPC+3.53	T.V.		4,087
BONO	6/12/2018	Intereses	11/12/2017	3,714.50	IPC+4.02	T.V.	67.44	
BONO	6/12/2018	Intereses	3/08/2018	7,387.00	IPC+4.02	T.V.	134.12	
BONO	6/12/2018	Intereses	23/04/2018	1,827.50	IPC+4.02	T.V.	33.18	
BONO	6/12/2018	Intereses	22/08/2017	1,889.10	IPC+4.02	T.V.	34.30	
BONO	6/12/2018	Intereses	14/09/2016	2,382.00	IPC+4.02	T.V.	43.25	
BONO	6/12/2018	Intereses	3/10/2016	5,742.00	IPC+3.87	T.V.	102.15	
BONO	6/12/2018	Intereses	1/09/2016	5,453.00	IPC+3.87	T.V.	97.01	
BONO	6/12/2018	Intereses	24/02/2016	8,840.00	IPC+4.02	T.V.	160.50	
BONO	6/12/2018	Intereses	22/02/2016	1,908.20	IPC+4.02	T.V.	34.65	
BONO	6/12/2018	Intereses	21/01/2016	2,180.00	IPC+3.87	T.V.	38.78	
BONO	6/12/2018	Intereses	21/10/2015	1,981.85	IPC+3.87	T.V.	35.26	

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

BONO	6/12/2018	Intereses	27/05/2016	2,903.00	IPC+3.87	T.V.	51.65	
BONO	6/12/2018	Intereses	21/05/2015	1,760.20	IPC+3.87	T.V.	31.31	
BONO	6/12/2018	Intereses	2/03/2015	5,025.00	IPC+4.02	T.V.	91.24	
BONO	7/12/2018	Intereses	24/09/2018	1,335.40	IPC+3.13	T.V.	20.58	
BONO	10/12/2018	Intereses	24/07/2012	20,920.00	IPC+4.19	T.V.	376.67	
BONO	10/12/2018	Intereses	1/09/2011	78,360.00	IPC+4.23	T.V.	1,418.53	
BONO	10/12/2018	Intereses	14/12/2016	1,982.50	IPC+4.19	T.V.	35.70	
BONO	10/12/2018	Intereses	30/12/2011	0.87	IPC+4.19	T.V.	0.02	
BONO	10/12/2018	Intereses	17/05/2013	2,946.70	IPC+4.19	T.V.	53.06	
BONO	10/12/2018	Intereses	21/11/2013	1,939.00	IPC+4.19	T.V.	34.91	
BONO	10/12/2018	Intereses	1/03/2012	4,977.00	IPC+4.23	T.V.	90.10	
BONO	10/12/2018	Intereses	30/05/2017	2,701.00	IPC+3.74	T.V.	45.67	
BONO	10/12/2018	Intereses	23/10/2017	1,886.40	IPC+3.74	T.V.	31.89	
BONO	10/12/2018	Intereses	19/02/2018	2,570.60	IPC+3.29	T.V.	40.63	
BONO	10/12/2018	Intereses	21/05/2018	1,852.00	IPC+3.29	T.V.	29.27	
BONO	10/12/2018	Intereses	5/05/2015	3,868.00	IPC+3.10	T.V.	60.95	
BONO	10/12/2018	Intereses	16/03/2015	1,638.00	IPC+3.95	T.V.	29.22	
BONO	10/12/2018	Intereses	1/08/2016	5,086.00	IPC+4.24	T.V.	94.32	
BONO	10/12/2018	Intereses	27/11/2015	2,436.00	IPC+4.24	T.V.	45.18	
BONO	10/12/2018	Intereses	23/11/2015	1,924.50	IPC+3.10	T.V.	30.32	
BONO	10/12/2018	Intereses	9/11/2018	1,086.50	IPC+3.95	T.V.	19.38	
BONO	10/12/2018	Intereses	2/02/2015	4,470.00	IPC+3.10	T.V.	70.43	
BONO	11/12/2018	Intereses	22/04/2013	1,417.78	IPC+3.75	T.V.	24.01	
BONO	11/12/2018	Intereses	5/02/2016	1,629.00	IPC+3.75	T.V.	27.58	

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	11/12/2018	Intereses	16/06/2014	1,510.00	IPC+3.75 T.V.	25.57	
BONO	11/12/2018	Intereses	16/12/2013	1,410.00	IPC+4.13 T.V.	25.18	
BONO	11/12/2018	Intereses	17/04/2013	17,050.00	IPC+3.75 T.V.	288.68	
BONO	11/12/2018	Intereses	27/08/2014	1,807.00	IPC+4.35 T.V.	33.99	
BONO	11/12/2018	Intereses	22/09/2017	1,068.98	IPC+3.59 T.V.	18.13	
BONO	11/12/2018	Intereses	29/02/2016	2,967.00	IPC+3.59 T.V.	50.31	
BONO	11/12/2018	Intereses	1/03/2016	5,463.00	IPC+3.59 T.V.	92.64	
BONO	11/12/2018	Intereses	22/08/2016	1,888.00	IPC+3.19 T.V.	30.17	
BONO	11/12/2018	Intereses	27/02/2018	2,389.25	IPC+3.19 T.V.	38.17	
BONO	11/12/2018	Intereses	1/12/2014	4,726.00	IPC+3.19 T.V.	75.51	
BONO	11/12/2018	Intereses	2/05/2016	4,270.00	IPC+3.19 T.V.	68.22	
BONO	11/12/2018	Intereses	27/06/2016	5,934.00	IPC+3.19 T.V.	94.81	



SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

BONO	11/12/2018	Intereses	21/01/2015	1,673.14	IPC+3.19	T.V.	26.73	
BONO	11/12/2018	Intereses	10/03/2015	2,827.00	IPC+3.19	T.V.	45.17	
BONO	11/12/2018	Intereses	4/11/2014	5,945.00	IPC+4.25	T.V.	110.39	
BONO	11/12/2018	Intereses	27/05/2014	1,556.50	IPC+4.25	T.V.	28.90	
BONO	13/12/2018	Intereses	2/04/2018	6,164.00	IPC+3.34	T.V.	98.18	
BONO	13/12/2018	Intereses	8/08/2017	1,881.00	IPC+3.34	T.V.	29.96	
BONO	13/12/2018	Intereses	21/04/2017	8,870.00	IPC+3.78	T.V.	150.83	
BONO	17/12/2018	Capital e Intereses	13/06/2016	1,474.20	IPC+3.89	T.V.	1,500.28	
BONO	17/12/2018	Capital e Intereses	14/09/2015	1,721.30	IPC+3.89	T.V.	1,751.75	
BONO	18/12/2018	Intereses	6/03/2017	2,525.00	IPC+4.00	T.V.	44.29	
BONO	18/12/2018	Intereses	27/02/2017	3,431.00	IPC+2.99	T.V.	51.70	
BONO	19/12/2018	Intereses	12/12/2011	1,417.00	IPC+4.70	T.V.	27.86	
BONO	19/12/2018	Intereses	1/12/2011	4,096.00	IPC+4.70	T.V.	80.54	
BONO	24/12/2018	Intereses	21/02/2018	1,828.00	IPC+3.90	T.V.	31.62	
BONO	24/12/2018	Intereses	22/01/2018	1,774.00	IPC+3.39	T.V.	28.47	
BONO	24/12/2018	Intereses	7/02/2018	1,528.00	IPC+3.39	T.V.	24.53	
BONO	24/12/2018	Intereses	1/12/2017	4,816.00	IPC+3.90	T.V.	83.31	
BONO	24/12/2018	Intereses	2/10/2017	6,488.00	IPC+3.90	T.V.	112.23	
BONO	24/12/2018	Intereses	4/07/2017	5,988.00	IPC+3.90	T.V.	103.58	
BONO	24/12/2018	Intereses	1/06/2017	6,085.00	IPC+3.90	T.V.	105.26	
BONO	24/12/2018	Intereses	28/05/2018	2,366.00	IPC+3.90	T.V.	40.93	
BONO	24/12/2018	Intereses	30/04/2018	6,250.00	IPC+3.90	T.V.	108.11	
BONO	24/12/2018	Intereses	1/11/2018	6,049.00	IPC+3.39	T.V.	97.09	
BONO	24/12/2018	Intereses	27/11/2018	2,070.00	IPC+3.90	T.V.	35.81	
BONO	24/12/2018	Intereses	3/12/2018	2,523.50	IPC+3.90	T.V.	43.65	
BONO	24/12/2018	Intereses	10/12/2018	2,340.00	IPC+4.09	T.V.	41.56	
BONO	24/12/2018	Intereses	3/04/2017	2,911.00	IPC+3.90	T.V.	50.35	
BONO	24/12/2018	Intereses	1/11/2016	7,702.00	IPC+3.39	T.V.	123.62	
BONO	24/12/2018	Intereses	21/11/2016	2,041.00	IPC+3.39	T.V.	32.76	
BONO	24/12/2018	Intereses	28/11/2016	3,748.80	IPC+3.90	T.V.	64.85	
BONO	24/12/2018	Intereses	25/01/2017	3,500.00	IPC+3.39	T.V.	56.18	
BONO	24/12/2018	Intereses	2/05/2017	7,666.00	IPC+3.90	T.V.	132.61	
BONO	26/12/2018	Intereses	28/08/2017	4,737.00	IPC+3.53	T.V.	79.63	
BONO	26/12/2018	Intereses	22/03/2018	1,280.18	IPC+3.53	T.V.	21.52	
BONO	26/12/2018	Intereses	7/11/2018	1,428.40	IPC+3.53	T.V.	24.01	
VALOR A INVERTIR							9,762.90	93,174

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



SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

						%.	\$		\$	
							VALOR COMPRA	VALOR NOMINAL	VALOR COMPRA	VALOR NOMINAL
CDT (1)	5/12/2018	5/06/2019	4.7437	P	V	4.81			24,584	24,584
CDT (1)	6/12/2018	6/03/2019	4.5227	P	V	4.67			21,525	21,525
CDT (1)	10/12/2018	10/12/2019	5.6000	P	V	5.60			5,144	5,144
CDT (1)	11/12/2018	11/04/2019	4.8700	P	V	4.98			4,339	4,339
CDT (1)	12/12/2018	12/04/2019	4.8221	P	V	4.93			14,840	14,840
CDT (1)	13/12/2018	13/03/2019	4.6194	P	V	4.77			9,516	9,516
CDT (1)	20/12/2018	20/03/2019	4.6194	P	V	4.77			4,642	4,642
CDT (1)	24/12/2018	9/01/2020	5.0552	P	V	5.04			4,497	4,497
CDT (1)	26/12/2018	26/06/2019	4.9878	P	V	5.06			4,087	4,087
TES	6/12/2018	11/09/2019	7.00	A	V	4.76	954.84	924.65		
TES	7/12/2018	11/09/2019	7.00	A	V	4.78	20.58	19.93		
BONO (2)	10/12/2018	22/06/2026	4.09	T	V	6.51	2,506.25	2,340.00		
BONO (2)	11/12/2018	27/11/2024	3.8	T	V	6.57	1,104.16	1,070.00		
TES	13/12/2018	11/09/2019	7.00	A	V	4.73	278.97	269.85		
BONO (2)	17/12/2018	8/09/2026	3.74	T	V	6.50	3,252.03	3,133.00		
TES	18/12/2018	11/09/2019	7.00	A	V	4.71	95.99	92.78		
TES	19/12/2018	11/09/2019	7.00	A	V	4.69	108.40	104.75		
BONO (2)	24/12/2018	13/04/2021	3.74	T	V	5.53	1,316.52	1,258.00		
TES	26/12/2018	11/09/2019	7.00	A	V	4.68	125.16	120.83		
TOTAL INVERTIDO							9,762.90	9,333.79	93,174	93,174

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

Atentamente,

LUIS FELIPE JIMENEZ SALAZAR
Superintendente Delegado para Pensiones.

411000

Este documento fue tomado directamente de la página oficial de la entidad que lo emitió.