

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

CARTA CIRCULAR 76 DE 2017
(Septiembre 22)

Señores

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

Referencia: Variación del portafolio de referencia el 1 de septiembre 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 septiembre 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	1/03/2017	13,677	7.2197 P. V.		14,171
CDT	Capital e Intereses	1/09/2016	200,000	8.60 P. V.		217,200
VALOR A INVEIRTIR POR VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES (A)						231,371
INCREMENTO (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (B)					6,445	4,461,534
PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION DE AGOSTO Y CUATRO POR MIL DE SEPTIEMBRE DE 2017 (C)						29,495
VALOR A INVERTIR EL 1 DE SEPTIEMBRE DE 2017 (A+B-C)					6,445	4,663,410

INVERSIONES EFECTUADAS EL 1 DE SEPTIEMBRE 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
BONO (1)	23/02/2024	IPC + 3.19 T V	6.50			250,000	247,150
BONO (1)	22/06/2020	IPC + 3.39 T V	6.10			290,000	280,200
BONO (1)	22/09/2021	IPC + 4.50 S V	6.41			290,000	263,550
BONO (1)	27/07/2021	IPC + 4.25 T V	6.47			290,000	276,000
BONO (1)	9/03/2019	7.04 T V	6.41			110,000	107,065
CDT (2)	1/02/2018	5.898 P V	5.96			80,000	80,000
CDT (2)	1/12/2017	6.4427 P V	6.62			350,000	350,000
CDT (2)	1/12/2017	5.294 P V	5.42			350,000	350,000
CDT (2)	1/03/2018	5.9126 P V	6.05			170,000	170,000
CDT (2)	19/01/2018	6.2779 P V	6.40			300,000	300,000
CDT (2)	2/03/2018	7.605 P V	7.75			223,410	223,410

INVERSIONES EFECTUADAS EL 1 DE SEPTIEMBRE 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
TES UVR (3)	17/03/2027	3.30 A V	3.23			200,000	196,001
TES UVR (4)	4/04/2035	4.75 A V	3.64			100,000	96,100
TES UVR (5)	23/02/2023	4.75 A V	2.91			260,000	232,899
TES UVR (6)	10/03/2021	3.5 A V	2.75			300,000	288,051
TES TF	11/09/2019	7.00 A V	5.46			200,000	182,350.00
TES TF	30/06/2032	7.00 A V	7.11			130,000	129,800.00
TES TF	18/09/2030	7.75 A V	6.91			140,000	122,300.00
TES TF	26/08/2026	7.50 A V	6.73			150,000	142,600.00
TES TF	24/07/2020	11.00 A V	5.75			200,000	174,250.00
TES TF	4/05/2022	7.00 A V	6.09			280,000	264,500.00
BONO (2)	22/09/2021	IPC + 4.50 S V	6.41	6,445	5,857		
TOTAL INVERTIDO				6,445	5,857	4,663,410	4,476,226

(1) Calificado AAA., (2) Tasa de captación en Bancos con calificación 1 (3) 794.61uvr, 778.72 uvr; (4) 397.30 uvr 381.81 uvr; (5) 1,032.99 uvr 925.92 uvr; (6) 1,191.91 uvr 1,144.44 uvr.

De otra parte, este Despacho se permite informar que del 2 al 29 de agosto 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	02/08/2017	Intereses	02/09/2013	223,140.00	IPC+4.45 TV		4,698
CDT	04/08/2017	Capital e Intereses	04/05/2017	22,588.00	6.4427 PV		22,952
CDT	08/08/2017	Capital e Intereses	07/02/2017	4,268.00	7.413 PV		4,427
CDT	08/08/2017	Capital e Intereses	06/07/2017	17,910.00	5.3668 PV		17,995
BONO	16/08/2017	Intereses	01/09/2014	230,770.00	IPC+3.42 TV		3,934
CDT	17/08/2017	Capital e Intereses	17/04/2017	28,344.00	6.9861 PV		29,004
CDT	22/08/2017	Capital e Intereses	22/02/2017	7,333.00	7.5572 PV		7,610
CDT	22/08/2017	Capital e Intereses	22/05/2017	50,030.00	5.9652 PV		50,776
BONO	22/08/2017	Intereses	01/09/2016	186,800.00	IPC+6.39 TV		5,130
CDT	25/08/2017	Capital e Intereses	25/08/2016	26,973.00	8.71 PV		29,322
CDT	28/08/2017	Capital e Intereses	27/02/2017	4,766.00	7.4616 PV		4,945
TES	28/08/2017	Intereses	03/09/2012	110,000.00	7.50 PV		8,250
TES	28/08/2017	Intereses	01/09/2016	199,700.00	7.50 PV		14,978
BONO	28/08/2017	Intereses	01/09/2016	199,400.00	IPC+3.14 TV		3,880
BONO	02/08/2017	Intereses	01/09/2014	6,223.00	IPC+4.62 TV	133.61	
BONO	02/08/2017	Intereses	06/09/2016	995.30	IPC+4.10 TV	20.09	
BONO	02/08/2017	Intereses	05/12/2016	3,933.00	IPC+4.62 TV	84.45	
BONO	03/08/2017	Intereses	27/02/2015	1,866.68	IPC+4.35 TV	38.84	
BONO	03/08/2017	Intereses	27/08/2015	2,329.15	IPC+4.35 TV	48.46	
BONO	03/08/2017	Intereses	10/06/2016	3,454.00	IPC+4.35 TV	71.86	
BONO	08/08/2017	Intereses	20/01/2015	4,737.50	IPC+3.80 TV	92.14	
BONO	08/08/2017	Intereses	29/08/2016	3,327.00	IPC+3.24 TV	60.08	
BONO	08/08/2017	Intereses	02/01/2017	7,486.00	IPC+3.55 TV	153.87	
BONO	08/08/2017	Intereses	14/03/2017	74,560.00	IPC+3.24 TV	1,346.53	

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Carta Circular 76 de 2017

Página 3

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	08/08/2017	Intereses	07/09/2015	2,146.00	IPC+4.00	TV	46.34	
BONO	08/08/2017	Intereses	10/12/2015	2,777.10	IPC+4.00	TV	59.97	
BONO	08/08/2017	Intereses	11/03/2016	1,315.00	IPC+4.00	TV	28.40	
BONO	08/08/2017	Intereses	21/02/2017	1,889.00	IPC+3.70	TV	39.39	
BONO	08/08/2017	Intereses	10/03/2017	4,700.00	IPC+4.00	TV	101.49	
BONO	09/08/2017	Intereses	14/03/2014	1,433.39	IPC+4.27	TV	31.91	
BONO	11/08/2017	Intereses	10/03/2016	4,557.00	IPC+3.49	TV	78.47	
BONO	14/08/2017	Intereses	11/09/2015	2,292.00	IPC+3.25	TV	45.23	
BONO	14/08/2017	Intereses	21/07/2016	2,842.00	IPC+3.25	TV	56.08	
BONO	15/08/2017	Intereses	12/12/2016	5,186.00	IPC+3.92	TV	94.82	
BONO	15/08/2017	Intereses	10/06/2014	1,758.80	IPC+4.23	TV	38.98	
BONO	15/08/2017	Intereses	10/12/2014	1,924.00	IPC+4.23	TV	42.64	
BONO	15/08/2017	Intereses	21/10/2016	2,829.00	IPC+3.89	TV	60.32	
BONO	16/08/2017	Intereses	21/07/2014	1,588.87	IPC+3.42	TV	27.09	
BONO	16/08/2017	Intereses	15/09/2014	1,495.15	IPC+3.42	TV	25.49	
BONO	16/08/2017	Intereses	21/07/2015	2,022.90	IPC+3.42	TV	34.48	
BONO	16/08/2017	Intereses	02/11/2015	5,854.00	IPC+3.42	TV	99.79	
BONO	16/08/2017	Intereses	01/06/2016	3,574.00	IPC+3.42	TV	60.93	
BONO	16/08/2017	Intereses	12/09/2016	7,148.34	IPC+3.42	TV	121.86	
BONO	17/08/2017	Intereses	10/09/2015	2,529.20	IPC+2.44	TV	44.79	
BONO	22/08/2017	Intereses	01/09/2011	61,120.00	12.59	TV	1,939.58	
BONO	22/08/2017	Intereses	23/05/2016	1,812.00	IPC+4.65	TV	42.04	
BONO	25/08/2017	Intereses	21/08/2014	1,651.00	IPC+5.90	TV	43.37	
BONO	25/08/2017	Intereses	15/12/2014	1,419.20	IPC+7.00	TV	41.07	
BONO	28/08/2017	Intereses	03/03/2014	8,105.00	5.65	TV	115.42	
TES	28/08/2017	Intereses	03/10/2011	3,992.00	7.50	AV	299.40	
TES	28/08/2017	Intereses	27/10/2011	30.60	7.50	AV	2.30	
TES	28/08/2017	Intereses	01/11/2011	4,280.00	7.50	AV	321.00	
TES	28/08/2017	Intereses	27/02/2012	1,802.00	7.50	AV	135.15	
TES	28/08/2017	Intereses	12/03/2012	1,619.00	7.50	AV	121.43	
TES	28/08/2017	Intereses	14/03/2012	1,532.50	7.50	AV	114.94	
TES	28/08/2017	Intereses	20/03/2012	105.83	7.50	AV	7.94	
TES	28/08/2017	Intereses	02/04/2012	4,391.00	7.50	AV	329.33	
TES	28/08/2017	Intereses	27/08/2012	2,872.55	7.50	AV	215.44	
TES	28/08/2017	Intereses	03/09/2012	4,504.45	7.50	AV	337.83	
TES	28/08/2017	Intereses	24/10/2012	7,217.00	7.50	AV	541.28	
TES	28/08/2017	Intereses	10/12/2012	1,637.00	7.50	AV	122.78	
TES	28/08/2017	Intereses	14/12/2012	1,271.10	7.50	AV	95.33	
TES	28/08/2017	Intereses	25/02/2013	6,842.00	7.50	AV	513.15	
TES	28/08/2017	Intereses	01/12/2016	4,780.00	7.50	AV	358.50	
BONO	28/08/2017	Intereses	01/09/2011	73,200.00	IPC+5.40	TV	1,833.28	
BONO	28/08/2017	Intereses	02/01/2012	5,417.00	IPC+5.99	TV	143.48	
BONO	28/08/2017	Intereses	01/04/2014	6,674.00	IPC+3.09	TV	129.04	
BONO	28/08/2017	Intereses	21/05/2014	1,953.40	IPC+3.09	TV	37.77	
BONO	28/08/2017	Intereses	09/03/2015	8,360.00	IPC+3.09	TV	161.64	
BONO	28/08/2017	Intereses	10/06/2015	2,525.00	IPC+3.09	TV	48.82	

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Carta Circular 76 de 2017

Página 4

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	28/08/2017	Intereses	01/02/2017	7,003.00	IPC+3.09 TV	135.41	
BONO	28/08/2017	Intereses	21/04/2015	1,788.40	IPC+3.14 TV	34.80	
BONO	28/08/2017	Intereses	21/08/2015	1,903.40	IPC+3.14 TV	37.04	
BONO	28/08/2017	Intereses	14/06/2016	2,291.00	IPC+5.69 TV	51.84	
BONO	28/08/2017	Intereses	01/07/2016	4,783.00	IPC+5.69 TV	108.22	
BONO	28/08/2017	Intereses	22/09/2016	1,584.00	IPC+5.69 TV	35.84	
BONO	29/08/2017	Intereses	03/08/2015	5,526.00	IPC+2.90 TV	104.22	
VALOR A INVERTIR						11,747.08	207,901

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)	02/08/2017	04/12/2017	5.9329	P	V	6.035		4,698	4,698
CDT (1)	04/08/2017	05/03/2018	5.8787	P	V	5.977		22,952	22,952
CDT (1)	08/08/2017	08/02/2018	6.1553	P	V	6.198		22,423	22,423
TES	16/08/2017	11/09/2019	7.00	A	V	5.36		3,934	3,589
TES	17/08/2017	04/05/2022	7.00	A	V	6.147		29,004	27,525
BONO (2)	22/08/2017	06/09/2022	IPC + 4.02	T	V	6.728		63,516	60,548
TES	25/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.373		29,322	28,376
TES	28/08/2017	04/05/2022	7.00	A	V	6.315		32,052	30,560
TES	02/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.134	238.15		230.57
TES	03/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.16	159.16		154.12
BONO (2)	08/08/2017	13/03/2021	IPC+ 3.34	T	V	7.019	1,928.21		1,881.00
TES	09/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.176	31.91		30.88
TES	11/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.248	78.47		75.98
TES	14/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.297	101.31		98.11
TES	15/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.305	236.76		229.27
TES	16/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.355	369.64		358.10
TES	17/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.364	44.79		43.39
BONO (2)	22/08/2017	06/09/2022	IPC + 4.02	T	V	6.728	1,981.62		1,889.10
TES	25/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.367	84.44		81.71
BONO (2)	28/08/2017	25/09/2021	IPC + 3.53	T	V	7.001	4,800.40		4,737.00
TES	28/08/2017	04/05/2022	7.00	A	V	6.314	1,588.00		1,514.00
TES	29/08/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.303	104.22		100.72
TOTAL INVERTIDO						11,747.08	11,423.95	207,901	200,671

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

Atentamente,

LUIS FELIPE JIMENEZ SALAZAR
Superintendente Delegado para Pensiones.