

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

CARTA CIRCULAR 35 DE 2017
(Abril 19)

Señores

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

Referencia: Variación del portafolio de referencia el 3 de abril 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 3 de abril 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	02/01/2017	11.403	2.967 P V		11,489
CDT	Capital e Intereses	27/12/2016	35.543	7.9173 P V		36,293
BONO	Intereses	14/12/2011	1.445	IPC+6.10 T V	39.63	
VALOR A INVERTIR POR VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES (A)					39.63	47,782

INCREMENTO (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (B)	3,021	(458,734)
--	-------	-----------

PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION DE MARZO Y CUATRO POR MIL DE ABRIL DE 2017 (C)		33,219
---	--	--------

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	24/10/2014	21/11/2018	49.075	5.00 A V		49,330
TES	25/02/2015	11/09/2019	388.900	7.00 A V		413,039
TÍTULOS A EXCLUIR (D)						462,369

VALOR A INVERTIR EL 3 DE ABRIL DE 2017 (A+B-C+D)	3,060.63	18,198
--	----------	--------

INVERSIONES EFECTUADAS EL 3 DE ABRIL 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)	03/10/2017 22/06/2023	7.3933 P V IPC+3.90 T V	7.51 8.22	3,060.63	2,911	18,198	18,198
TOTAL INVERTIDO				3,060.63	2,911	18,198	18,198

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

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Carta Circular 35 de 2017

Página 2

De otra parte, este Despacho se permite informar que del 3 al 27 de marzo 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	06/03/2017	Capital e Intereses	06/12/2016	9,018.00	7.771	PV		9,193.00
BONO	06/03/2017	Intereses	01/09/2016	190,600.00	IPC+3.87	TV		4,336.00
BONO	10/03/2017	Intereses	01/09/2014	285,700.00	IPC+4.19	TV		7,056.00
BONO	10/03/2017	Intereses	02/09/2013	256,000.00	IPC+3.88	TV		6,129.00
BONO	10/03/2017	Intereses	03/09/2012	270,000.00	IPC+3.88	TV		6,465.00
TES	10/03/2017	Intereses	01/09/2014	1,354.10	3.50	AV		11,637.00
TES	10/03/2017	Intereses	24/07/2015	441.79	3.50	AV		3,797.00
TES	10/03/2017	Intereses	01/09/2016	809.30	3.50	AV		6,955.00
TES	10/03/2017	Intereses	01/09/2016	809.30	3.50	AV		6,955.00
TES	10/03/2017	Intereses	01/09/2016	809.30	3.50	AV		6,955.00
TES	10/03/2017	Intereses	01/09/2015	1,083.70	3.50	AV		9,314.00
BONO	10/03/2017	Intereses	01/09/2015	57,700.00	IPC+3.10	TV		1,164.00
BONO	10/03/2017	Intereses	23/11/2015	306,570.00	IPC+3.10	TV		6,187.00
CDT	13/03/2017	Capital e Intereses	12/12/2016	38,014.00	7.677	PV		38,752.00
CDT	13/03/2017	Capital e Intereses	13/12/2016	79,020.00	7.582	PV		80,518.00
BONO	13/03/2017	Intereses	01/09/2015	233,640.00	IPC+4.25	TV		5,368.00
CDT	16/03/2017	Capital e Intereses	06/09/2016	249,336.00	8.0473	PV		259,926.00
CDT	17/03/2017	Capital e Intereses	17/11/2016	10,373.00	7.129	PV		10,619.00
CDT	21/03/2017	Capital e Intereses	19/10/2016	11,341.00	7.727	PV		11,711.00
CDT	27/03/2017	Capital e Intereses	26/12/2016	68,750.00	7.393	PV		70,035.00
TES	27/03/2017	Intereses	01/09/2014	621.20	3.00	AV		4,599.00
BONO	27/03/2017	Intereses	01/09/2015	243,100.00	IPC+3.53	TV		5,161.00
CDT	27/03/2017	Capital e Intereses	26/08/2016	8,250.00	7.872	PV		8,631.00
BONO	03/03/2017	Intereses	10/12/2013	1,701.00	IPC+5.20	TV	44.16	
BONO	03/03/2017	Intereses	01/11/2012	4,297.00	IPC+4.84	TV	107.84	
BONO	03/03/2017	Intereses	14/03/2016	2,174.00	IPC+4.84	TV	54.56	
BONO	03/03/2017	Intereses	27/11/2012	1,565.00	IPC+4.84	TV	39.28	
BONO	03/03/2017	Intereses	01/10/2012	4,555.00	IPC+4.84	TV	114.31	
BONO	06/03/2017	Intereses	01/09/2016	5,453.00	IPC+3.87	TV	124.05	
BONO	06/03/2017	Intereses	02/03/2015	5,025.00	IPC+4.02	TV	116.14	
BONO	06/03/2017	Intereses	03/10/2016	5,742.00	IPC+3.87	TV	130.63	
BONO	06/03/2017	Intereses	14/09/2016	2,382.00	IPC+4.02	TV	55.06	
BONO	06/03/2017	Intereses	21/10/2015	1,981.85	IPC+3.87	TV	45.09	
BONO	06/03/2017	Intereses	21/01/2016	2,180.00	IPC+3.87	TV	49.59	
BONO	06/03/2017	Intereses	22/02/2016	1,908.20	IPC+4.02	TV	44.10	
BONO	06/03/2017	Intereses	27/05/2016	2,903.00	IPC+3.87	TV	66.04	
BONO	06/03/2017	Intereses	24/02/2016	8,840.00	IPC+4.02	TV	204.32	
BONO	06/03/2017	Intereses	21/05/2015	1,760.20	IPC+3.87	TV	40.04	
BONO	06/03/2017	Intereses	21/11/2011	1,770.00	IPC+5.80	TV	1,820.58	
BONO	10/03/2017	Intereses	17/05/2013	2,946.70	IPC+4.19	TV	72.77	
BONO	10/03/2017	Intereses	01/03/2012	4,977.00	IPC+4.23	TV	123.39	
BONO	10/03/2017	Intereses	21/11/2013	1,939.00	IPC+4.19	TV	47.88	
BONO	10/03/2017	Intereses	19/12/2011	118.39	IPC+3.88	TV	2.83	

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

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	10/03/2017	Intereses	30/12/2011	0.87	IPC+4.19	TV	0.02	
BONO	10/03/2017	Intereses	01/09/2011	78,360.00	IPC+4.23	TV	1,942.75	
BONO	10/03/2017	Intereses	24/07/2012	20,920.00	IPC+4.19	TV	516.63	
BONO	10/03/2017	Intereses	14/12/2016	1,982.50	IPC+4.19	TV	48.96	
TES	10/03/2017	Intereses	01/10/2013	28.30	3.50	AV	243.22	
TES	10/03/2017	Intereses	23/02/2017	38.08	3.50	AV	327.27	
TES	10/03/2017	Intereses	01/10/2015	20.02	3.50	AV	172.06	
TES	10/03/2017	Intereses	02/01/2015	33.65	3.50	AV	289.20	
TES	10/03/2017	Intereses	21/08/2012	9.39	3.50	AV	80.70	
TES	10/03/2017	Intereses	15/08/2012	18.41	3.50	AV	158.22	
TES	10/03/2017	Intereses	28/04/2015	26.99	3.50	AV	231.96	
TES	10/03/2017	Intereses	28/04/2014	15.28	3.50	AV	131.32	
TES	10/03/2017	Intereses	01/09/2015	19.47	3.50	AV	167.33	
BONO	10/03/2017	Intereses	02/02/2015	4,470.00	IPC+3.10	TV	90.21	
BONO	10/03/2017	Intereses	05/05/2015	3,868.00	IPC+3.10	TV	78.06	
BONO	10/03/2017	Intereses	16/03/2015	1,638.00	IPC+3.95	TV	36.44	
BONO	10/03/2017	Intereses	27/11/2015	2,436.00	IPC+4.24	TV	55.91	
BONO	10/03/2017	Intereses	23/11/2015	1,924.50	IPC+3.10	TV	38.84	
BONO	10/03/2017	Intereses	01/08/2016	5,086.00	IPC+4.24	TV	116.73	
BONO	13/03/2017	Intereses	16/06/2014	1,510.00	IPC+3.75	TV	35.68	
BONO	13/03/2017	Intereses	16/12/2013	1,410.00	IPC+4.13	TV	34.62	
BONO	13/03/2017	Intereses	17/04/2013	17,050.00	IPC+3.75	TV	402.84	
BONO	13/03/2017	Intereses	22/04/2013	1,417.78	IPC+3.75	TV	33.50	
BONO	13/03/2017	Intereses	05/02/2016	1,629.00	IPC+3.75	TV	38.49	
BONO	13/03/2017	Intereses	02/05/2016	4,270.00	IPC+3.19	TV	87.11	
BONO	13/03/2017	Intereses	27/08/2014	1,807.00	IPC+4.35	TV	41.95	
BONO	13/03/2017	Intereses	01/12/2014	4,726.00	IPC+3.19	TV	96.42	
BONO	13/03/2017	Intereses	27/06/2016	5,934.00	IPC+3.19	TV	121.06	
BONO	13/03/2017	Intereses	29/02/2016	2,967.00	IPC+3.59	TV	63.42	
BONO	13/03/2017	Intereses	01/03/2016	5,463.00	IPC+3.59	TV	116.77	
BONO	13/03/2017	Intereses	22/08/2016	1,888.00	IPC+3.19	TV	38.52	
BONO	13/03/2017	Intereses	10/03/2015	2,827.00	IPC+3.19	TV	57.67	
BONO	13/03/2017	Intereses	21/01/2015	1,673.14	IPC+3.19	TV	34.13	
BONO	13/03/2017	Intereses	04/11/2014	5,945.00	IPC+4.25	TV	136.59	
BONO	13/03/2017	Intereses	27/05/2014	1,556.50	IPC+4.25	TV	35.76	
BONO	14/03/2017	Intereses	01/09/2011	73,250.00	IPC+5.30	TV	75,118.36	
BONO	15/03/2017	Intereses	13/06/2016	1,474.20	IPC+3.89	TV	32.58	
BONO	15/03/2017	Intereses	14/09/2015	1,721.30	IPC+3.89	TV	38.05	
BONO	21/03/2017	Intereses	21/04/2014	1,429.06	IPC+3.69	TV	33.56	
BONO	21/03/2017	Intereses	06/03/2017	2,525.00	IPC+4.00	TV	61.19	
BONO	21/03/2017	Intereses	27/02/2017	3,431.00	IPC+2.99	TV	74.70	
BONO	21/03/2017	Intereses	01/12/2011	4,096.00	IPC+4.70	TV	98.56	
BONO	21/03/2017	Intereses	12/12/2011	1,417.00	IPC+4.70	TV	34.10	
BONO	22/03/2017	Intereses	25/01/2017	3,500.00	IPC+3.39	TV	79.62	
BONO	22/03/2017	Intereses	28/11/2016	3,748.80	IPC+3.90	TV	89.94	

SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Carta Circular 35 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	22/03/2017	Intereses	21/11/2016	2,041.00	IPC+3.39	TV	46.43	
BONO	22/03/2017	Intereses	01/11/2016	7,702.00	IPC+3.39	TV	175.22	
TES	27/03/2017	Intereses	03/02/2014	44.46	3.00	AV	329.19	
TES	27/03/2017	Intereses	01/02/2016	44.20	3.00	AV	327.26	
TES	27/03/2017	Intereses	27/02/2014	7.89	3.00	AV	58.42	
VALOR A INVERTIR							86,000.20	581,463.00

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	
CDT (1)	06/03/2017	06/06/2017	7.1083	P	V	7.238			13,529
CDT (1)	10/03/2017	12/06/2017	7.0147	P	V	7.143			72,614
CDT (1)	13/03/2017	13/09/2017	7.2679	P	V	7.337			124,638
CDT (1)	16/03/2017	16/06/2017	7.1083	P	V	7.238			259,926
CDT (1)	17/03/2017	18/09/2017	7.1721	P	V	7.239			10,619
CDT (1)	21/03/2017	21/09/2017	7.1714	P	V	7.238			11,711
CDT (1)	27/03/2017	27/10/2017	6.9984	P	V	7.063			88,426
TES	03/03/2017	21/11/2018	5.0000	A	V	6.17	360.15	361.92	
BONO (2)	06/03/2017	18/03/2025	IPC+4.00	T	V	8.828	2,695.64	2,525.00	
BONO (2)	10/03/2017	08/05/2024	IPC+4.00	T	V	8.399	4,972.70	4,700.00	
TES	13/03/2017	21/11/2018	5.0000	A	V	6.155	1,374.53	1,378.70	
BONO (2)	14/03/2017	07/05/2019	IPC+3.24	T	V	8.612	75,118.36	74,560	
TES	15/03/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.154	70.63	70.82	
TES	21/03/2017	21/11/2018	5.00	A	V	6.034	302.11	302.07	
TES	22/03/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.985	391.21	390.80	
TES	27/03/2017	21/11/2018	5.00	A	V	5.841	714.87	712.00	
TOTAL INVERTIDO							86,000.20	85,001.31	581,463

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

Atentamente,

LUIS FELIPE JIMENEZ SALAZAR
Superintendente Delegado para Pensiones.

411000