**CARTA CIRCULAR 52 DE 2018**

**( Agosto 16 )**

**Señores**

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

**Referencia: Variación del portafolio de referencia el 1 de agosto de 2018**

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 agosto de 2018 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:

|  |  |
| --- | --- |
| **FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS**  **$** | **PORTAFOLIO LARGO PLAZO**  **FONDO DE CESANTIA**  **$** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| INCREMENTO (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (A) | 6,981.38 | (391,656) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION DE JULIO Y CUATRO POR MIL DE AGOSTO DE 2018 (B) |  | 32,890 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | 1/09/2017 | 4/05/2022 | 264,500 | 7.00 | A | V |  | 279,481 |
| CDT | 27/04/2018 | 29/04/2019 | 108,926 | 5.101 | P | V |  | 110,411 |
| CDT | 2/02/2018 | 2/08/2018 | 9,507 | 5.183 | P | V |  | 9,751 |
| CDT | 21/05/2018 | 23/08/2018 | 6,135 | 4.717 | P | V |  | 6,192 |
| CDT | 28/05/2018 | 28/08/2018 | 7,694 | 4.803 | P | V |  | 7,760 |
| CDT | 6/06/2018 | 6/09/2018 | 12,285 | 4.232 | P | V |  | 12,360 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| TÍTULOS A EXCLUIR (C) | | | | |  | |  | 425,955 |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| VALOR A INVERTIR EL 1 DE AGOSTO DE 2018 (A-B+C) | 6,981.38 | 1,409 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | **INVERSIONES EFECTUADAS EL 1 DE AGOSTO DE 2018** | | | | | | | |
| **CLASE DE TITULO** | **FECHA DE**  **VENCIMIENTO** | **TASA**  **NOMINAL %** | | | **TIR DE**  **COMPRA**  **E.A.**  **%** | **FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS**  **$** | | **PORTAFOLIO LARGO PLAZO**  **FONDO DE CESANTIA**  **$** | |
|  |  | VALORCOMPRA | VALORNOMINAL | VALORCOMPRA | VALORNOMINAL |
| TES | | 21/11/2018 | 5.00 | A | V | 4.46 |  |  | 1,409 | 1,360 |
| TES (\*) | | 17/03/2027 | 3.30 | A | V | 3.19 | 6,981.38 | 6,844.11 |  |  |
| TOTAL INVERTIDO | | | | | | | 6,981.38 | 6,844.11 | 1,409 | 1,360 |

(\*) 26.89 uvr – 26.36 uvr.

De otra parte, este Despacho se permite informar que, del 9 al 30 de julio de 2018, se presentaron las siguientes modificaciones:

Carta Circular 52 de 2018 Página 2

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | 9/07/2018 | Capital e Intereses | 9/03/2018 | 1,859 | 5.1124 | PV |  | 1,891 |
| CDT | 9/07/2018 | Capital e Intereses | 9/01/2018 | 587,021 | 5.6696 | PV |  | 603,662 |
| CDT | 18/07/2018 | Capital e Intereses | 18/04/2018 | 310,779 | 4.7159 | PV |  | 314,443 |
| CDT | 19/07/2018 | Capital e Intereses | 19/01/2018 | 307,224 | 5.3290 | PV |  | 315,410 |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/04/2011 | 149,700 | 10.00 | AV |  | 14,970 |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/09/2015 | 259,000 | 10.00 | AV |  | 25,900 |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/09/2016 | 257,000 | 10.00 | AV |  | 25,700 |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/06/2011 | 140,700 | 10.00 | AV |  | 14,070 |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/09/2016 | 257,000 | 10.00 | AV |  | 25,700 |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 2/09/2013 | 178,750 | 10.00 | AV |  | 17,875 |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 3/09/2012 | 160,000 | 10.00 | AV |  | 16,000 |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/08/2011 | 117,300 | 10.00 | AV |  | 11,730 |
| CDT | 26/07/2018 | Capital e Intereses | 26/03/2018 | 18,139 | 5.0157 | PV |  | 18,442 |
| BONO | 27/07/2018 | Intereses | 1/09/2017 | 276,000 | 4.25 | TV |  | 5,078 |
| BONO | 9/07/2018 | Intereses | 14/12/2015 | 2,128.00 | 3.96 | TV | 37.33 |  |
| BONO | 9/07/2018 | Intereses | 27/05/2015 | 2,082.82 | 3.25 | TV | 32.92 |  |
| BONO | 23/07/2018 | Intereses | 1/09/2011 | 74,280.00 | 5.05 | TV | 1,499.88 |  |
| BONO | 23/07/2018 | Intereses | 28/11/2011 | 1,218.00 | 6.08 | TV | 27.62 |  |
| BONO | 23/07/2018 | Intereses | 2/12/2013 | 4,559.00 | 5.05 | TV | 92.06 |  |
| BONO | 23/07/2018 | Intereses | 3/06/2014 | 5,486.70 | 5.89 | TV | 121.91 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 19/09/2016 | 8,432.00 | 11.00 | AV | 927.49 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 28/04/2016 | 5,134.87 | 11.00 | AV | 564.82 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/08/2013 | 5,096.00 | 11.00 | AV | 560.54 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 26/08/2013 | 2,394.55 | 11.00 | AV | 263.39 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/04/2015 | 4,761.00 | 11.00 | AV | 523.69 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 14/09/2011 | 1,271.70 | 10.00 | AV | 127.17 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 4/05/2015 | 4,011.62 | 11.00 | AV | 441.26 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 16/06/2015 | 3,273.90 | 11.00 | AV | 360.12 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/09/2011 | 212,000.00 | 10.00 | AV | 21,199.25 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 23/02/2016 | 8,076.00 | 11.00 | AV | 888.33 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 1/12/2015 | 5,245.00 | 11.00 | AV | 576.93 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 26/10/2015 | 8,338.00 | 11.00 | AV | 917.15 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 18/09/2015 | 2,195.10 | 11.00 | AV | 241.45 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 21/10/2014 | 1,348.45 | 11.00 | AV | 148.32 |  |
| TES | 24/07/2018 | Intereses | 2/09/2013 | 4,986.73 | 11.00 | AV | 548.52 |  |
| BONO | 26/07/2018 | Intereses | 11/09/2017 | 5,400.00 | 3.90 | TV | 93.94 |  |
| BONO | 26/07/2018 | Intereses | 12/06/2017 | 4,105.00 | 3.90 | TV | 71.41 |  |
| BONO | 26/07/2018 | Intereses | 23/01/2017 | 2,695.00 | 3.90 | TV | 46.88 |  |
| BONO | 27/07/2018 | Intereses | 1/02/2012 | 3,820.00 | 4.25 | TV | 70.28 |  |
| BONO | 27/07/2018 | Intereses | 21/10/2011 | 1,471.00 | 4.60 | TV | 28.32 |  |
| BONO | 27/07/2018 | Intereses | 23/04/2012 | 1,575.80 | 4.05 | TV | 1,604.02 |  |
| BONO | 27/07/2018 | Intereses | 21/10/2013 | 1,468.50 | 4.25 | TV | 27.02 |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

Carta Circular 52 de 2018 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 | 27/07/2018 | Intereses | 21/04/2016 | 2,401.00 | 4.25 | TV | 44.17 |  |
| BONO | 27/07/2018 | Intereses | 8/05/2017 | 2,498.00 | 3.66 | TV | 41.99 |  |
| BONO | 30/07/2018 | Intereses | 21/05/2013 | 1,858.00 | 3.05 | TV | 28.45 |  |
| BONO | 30/07/2018 | Intereses | 1/04/2016 | 6,457.00 | 3.64 | TV | 108.22 |  |
| VALOR A INVERTIR | | | | | | | 32,264.84 | 1,410,871 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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) | 9/07/2018 | 9/01/2019 | 4.8414 | P | V | 4.8591 |  |  | 605,553 | 605,553 |
| CDT(1) | 18/07/2018 | 18/10/2018 | 4.5227 | P | V | 4.5616 |  |  | 314,443 | 314,443 |
| CDT(1) | 19/07/2018 | 19/03/2019 | 4.8018 | P | V | 4.8468 |  |  | 315,410 | 315,410 |
| TESUVR (2) | 24/07/2018 | 7/05/2025 | 3.5000 | A | V | 2.8743 |  |  | 151,945 | 145,335 |
| CDT(1) | 26/07/2018 | 26/10/2018 | 4.7159 | P | V | 4.7600 |  |  | 18,442 | 18,442 |
| CDT(1) | 27/07/2018 | 27/11/2018 | 5.4021 | P | V | 5.4388 |  |  | 5,078 | 5,078 |
| TESTF | 9/07/2018 | 21/11/2018 | 5.00 | A | V | 4.1974 | 70.25 | 67.93 |  |  |
| TESTF | 30/07/2018 | 21/11/2018 | 5.00 | A | V | 4.3386 | 136.67 | 131.90 |  |  |
| BONO (3) | 23/07/2018 | 8/05/2023 | IPC+3.08 | T | V | 6.2000 | 1,741.47 | 1,707.60 |  |  |
| BONO (3) | 27/07/2018 | 21/11/2020 | IPC+4.35 | T | V | 5.7023 | 1,815.80 | 1,722.50 |  |  |
| TESUVR (4) | 24/07/2018 | 7/05/2025 | 3.50 | A | V | 2.8730 | 28,288.42 | 27,055.67 |  |  |
| TESTF | 26/07/2018 | 21/11/2018 | 5.00 | A | V | 4.2942 | 212.23 | 204.89 |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| TOTAL INVERTIDO | | | | | | | 32,264.84 | 30,890.49 | 1,410,871 | 1,404,261 |

(1) Tasa de captación en Bancos con calificación 1+; (2) 585,47 UVR, 560 UVR; (3) Calificado AAA; (4) 109UVR, 104.25 UVR.

Atentamente,

**LUIS FELIPE JIMENEZ SALAZAR**

Superintendente Delegado para Pensiones.

411000