Anexo No. 1: INFORME DE SUPERVISIÓN MES DE NOVIEMBRE 2021 – PATRIMONIO AUTÓNOMO FPPB – Contrato 148 de 2021

3. Productos y bienes entregados Detalle del análisis a la Gestión

3.1 Remisión de los informes de Gestión del mes de noviembre 2021

Presentados por Fiduoccidente fueron compartidos a los supervisores y personas de apoyo.

3.2 Verificación del valor de los recursos invertidos, rentabilidad generada, flujo de caja, duración, composición del portafolio, Operaciones (compras, ventas y redenciones), nivel de cumplimiento de las estrategias de inversión proyectadas, verificación del cumplimiento de cupos y límites.

- **Recursos Invertidos**

El total de los Activos fue de $2,624,965,312,641.32, de acuerdo con el Balance General.

El total del valor del portafolio de inversiones presentado en flujo de caja fue de $2.624.963.093.352,03.

Presentándose una diferencia de $2.219.289,29, que corresponde a una cuenta por cobrar de gastos bancarios a corte noviembre de 2021, los cuales Fiduoccidente indica en el Informe que se reintegran en el mes de diciembre.

Rentabilidad Generada y duración:

Rendimientos cuentas bancarias	Rendimientos Portafolio de Inversiones	Total rendimientos
$59.212.397,62	-$22.532.517.902,39	-$22.473.305.504,77

Los rendimientos negativos de noviembre 2021 que coincide con lo reportados en el Balance General generaron una rentabilidad mensual de -9,77%.

Los porcentajes de las rentabilidades incluidas en la presentación para el Comité Fiduciario No. 4 se reflejan en el siguiente cuadro.

MES 2021	MENSUAL	12 MESES	AÑO CORRIDO	DURACIÓN
Agosto	17.30%	3,01%	-0,26%	967
Septiembre	-3,98%	1,23%	-0,66%	944
Octubre	-5,32%	0,37%	-1,13%	918
Noviembre	-9,77%	-1,30%	-1,90%	900

Durante el mes de noviembre de 2021 continuó la desvalorización de los activos. La deuda pública presentó desvalorización de 25 pbs en promedio.

La deuda privada fue impactada por la causación negativa de los bonos
.
Todos los plazos e indicadores se desvalorizaron durante el mes.
.

Es siguiente cuadro muestra el detalle de la participación de las clases de títulos en la causación de los rendimientos.

Titulo	Valor Mercado	% de Part.
Tés Tasa Fija	-2,745.35	12.22%
Tés Uvr	-2,638.08	11.74%
Cdt	-2,098.26	9.34%
Bonos	-14,959.81	66.57%
Titularizaciones	-104.76	0.47%
Bonos Pensionales	5.76	(0.03%)
Depósitos a la vista	67.19	(0.30%)
TOTAL	**-22,473.31**	**100.00%**

- **Composición del Portafolio:**

  - **Por tipo de Sector:** La mayor participación se encuentra en el Sector Público con el 42.84% seguido del Sector Financiero con el 28.84%.
  - **Por tipo de Calificación:** La mayor participación está en AAA con el 51.15%, seguido por las inversiones Nación con 42.95%.
  - **Por Tipo de Tasa:** La mayor participación está en Tasa Fija con el 42.66%, seguido del IPC con el 37.77%.
  - **Por plazo al Vencimiento:** En su mayoría representado por títulos con vencimiento entre 1096-1825 días con el 20.65%, seguido por el plazo de 1826 - 3650 días con el 20.16%.
  - **Por tipo de papel:** El cuadro por tipo de papel quedó con otro tipo de composición. Se solicitará su arreglo y alcance.

- **Operaciones (compras, ventas y redenciones)**

Durante el mes de noviembre hubo operaciones de compra por 51.047.700.000.
No se presentaron ventas y las redenciones fueron de $77.675.658.953,19.

3.3 De los aportes y traslados

Aportes:

Los aportes presentados en el Flujo de Caja en el Informe de Portafolio de Inversiones y en el informe de cuentas está por $ 6.022.856.832,05 y reintegro de gastos bancarios por $964.642,25

Traslados:

Se realizaron 5 traslados para pago de obligaciones pensionales por valor de $54.648.247.034,00, valor que se refleja registrado correctamente en el Balance General.

3.4 Conciliaciones Bancarias:

Las conciliaciones bancarias reflejan 4 partidas conciliatorias con antigüedad menor a 30 días.

El informe de cuentas bancarias es el siguiente:

Banco	Tipo	Uso	No. Cuenta	Saldo Inicial	Saldo Final	tasa de interés reconocida	intereses generados
Banco de Occidente	Ahorros	Portafolio	256121849	$ 58.053.478.248,65	$ 49.707.507.826,12	2,35%	$ 55.756.033,13
Banco de Occidente	Ahorros	Recaudo Referenciado	256122037	$ 11.538.959.654,45	$ 34.880.579,86	2,35%	$ 2.550.812,98
Banco de Occidente	Ahorros	PSE Codigo de barras	256122011	$ 2.123.176.391,28	$ 41.861.870,25	2,35%	$ 904.498,84
Banco de Occidente	Corriente	Portafolio	256121955	$ 1.000.000,00	$ 314.593,05	2,35%	$ -
Banco de Occidente	Ahorros	Portafolio	256122649	$ -	$ 532.512,09	2,35%	$ 1.052,67
Banco BBVA	Ahorros	Portafolio	895003218	$ -	$ -	1,00%	$ -
Total				**$ 71.716.614.294,38**	**$ 49.785.097.381,37**		**$ 59.212.397,62**

3.5 Comité Fiduciario de Seguimiento

Se realizó el Comité Fiduciario No. 4, en diciembre 16 de 2021, analizando la gestión del mes de noviembre 2021.

3.6 Relación de solvencia:

A la fecha no se ha recibido la certificación de la Relación de Solvencia de noviembre 2021.

3.7 Cubrimiento Póliza Global Bancaria

Se recibió certificación de seguros La Previsora, en la que se evidencia que se encuentra amparado Fiduciaria de Occidente S.A. y todos los fondos y fideicomisos bajo su custodia y se encuentra vigente hasta el 15 de junio de 2022.

3.8 Estados Financieros

Se recibió información financiera la cual plasma las operaciones realizadas, el Balance General y Estado de Resultados, reflejando correctamente la información.

Firmas,

ANGÉLICA MALAVER GALLEGO
Subdirectora Financiera y Administrativa
Supervisora

ESMERALDA TRIANA POSADA
Responsable Área de Tesorería
Supervisora

AÍDA GUZMÁN CRUZ
Profesional Especializada – Área de Tesorería
Supervisora

Bogotá D.C., diciembre 27 de 2021