

CARTA CIRCULAR No. 85 DE 2002
(Julio 09)

Señores
REPRESENTANTES LEGALES DE LAS SOCIEDADES ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE PENSIONES Y DE CESANTIA.

Referencia: Variación de los portafolios de referencia el 1 de julio de 2002

Apreciados señores:

De acuerdo con lo dispuesto en la Circular Externa 79 de 1995, modificada por la Circular Externa 61 de 1998, el primero de julio de 2002 la composición de los portafolios de referencia de los fondos de pensiones obligatorias y los fondos de cesantía, presentó las siguientes modificaciones:

VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES						
CLASE DE TITULO	VENCIMIENTO	FECHA DE COMPRA	VALOR NOMINAL \$	TASA NOMINAL	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$	FONDO DE CESANTIA \$
BONO	INTERESES	1-ene-02	61.556	DTF+ 1.07% T.V.	9.831 12.393 60.000	1.716
CDT	INTERESES	1-oct-01	88.121	11.14% T.V.		2.454
CDT	CAPITAL E INTERESES	1-may-02	29.701	7.83% P.V.		30.089
CDT	CAPITAL E INTERESES	1-jun-02	53.613	4.90% P.V.		53.832
BONO	INTERESES	1-abr-01	306.485	DTF+ 2.65% T.V.		
BONO	INTERESES	1-ene-02	444.433	DTF + 1.07% T.V.		
TES	INTERESES	1-abr-02	400.000	15% A.V.		
VALOR A INVERTIR POR VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES (A)						82.224
INCREMENTO O (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (B)					128.365	(144.966)
PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION Y GARANTIA FOGAFIN DEL MES DE JUNIO DE 2002 Y TRES POR MIL DEL MES DE JULIO DE 2002 (C)						15.871
TITULO EXCLUIDO POR DISMINUCION DE LOS APORTES NETOS						
CLASE DE TITULO	FECHA DE COMPRA	VALOR NOMINAL \$	TASA FACIAL	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$	FONDO DE CESANTIA \$	
TES	1-mar-02	100.000	13% A.V.		112.177	
VALOR A EXCLUIR POR DISMINUCION DE LOS APORTES NETOS (D)						112.177
VALOR A INVERTIR EL 1 DE JULIO DE 2002 (A+B-C+D)					210.589	39.431

INVERSIONES EFECTUADAS EL 1 DE JULIO DE 2002								
CLASE DE TITULO	FECHA DE VENCIMIENTO	TASA FACIAL	TASA NEGOCIACION E.A.	MARGEN INICIAL	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$		FONDO DE CESANTIA \$	
					VALOR NOMINAL	VALOR COMPRA	VALOR NOMINAL	VALOR COMPRA
TES CDT	2-sep-11 1-ago-02	8% A.V. 6.25 % P.V.	7.09% 6.31%	0% 0%	187.100(1)	210.589(2)		39.431
TOTAL INVERTIDO					187.100(1)	210.589(2)		39.431

(1) 1.474,8774 UVR (2) 1.660,0372 UVR

De otra parte, este Despacho se permite informar que los intereses vencidos el 21 de junio de 2002 fueron invertidos de la siguiente manera:

INTERESES VENCIDOS						
CLASE DE TITULO	VENCIMIENTO	FECHA DE COMPRA	VALOR NOMINAL UVR	TASA NOMINAL	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$	FONDO DE CESANTIA \$
TES	INTERESES	1-mar-02	1.715,9540	8% A.V.		17.380(1)
VALOR A INVERTIR POR VENCIMIENTO DE INTERESES						17.380

(1) 137,28 UVR

INVERSIONES EFECTUADAS								
CLASE DE TITULO	FECHA DE VENCIMIENTO	TASA FACIAL	TASA NEGOCIACION E.A.	MARGEN INICIAL	FONDO DE PENSIONES OBLIGATORIAS \$		FONDO DE CESANTIA \$	
					VALOR NOMINAL	VALOR COMPRA	VALOR NOMINAL	VALOR COMPRA
CDT	1-ago-02	6.41% P.V.	6.52%	0%				17.380
TOTAL INVERTIDO								17.380

Cordialmente,

EDUARDO OREJUELA SUAREZ
Superintendente Delegado para Entidades
Administradoras de Pensiones y Cesantía (E).