

SUPERINTENDENCIA BANCARIA
DE COLOMBIA

CARTA CIRCULAR No. 99 DE 2002
(Agosto 14)

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

Referencia: Variación de los portafolios de referencia el 1 de agosto 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 agosto 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 \$
CDT	INTERESES	1-may-02	62.527	10.01% T.V.	1.565	17.504 39.636
CDT	CAPITAL E INTERESES	4-feb-02	42.000	10.99% P.V.	44.269	
CDT	CAPITAL E INTERESES	21-jun-02	17.380	6.41% P.V.		
CDT	CAPITAL E INTERESES	1-jul-02	39.431	6.25% P.V.		
BONO	INTERESES	1-may-01	619.128	DTF+2.73% T.V.	19.027	
BONO	INTERESES	1-ago-01	320.269	DTF+2.47% T.V.	9.621	
TES	CAPITAL E INTERESES	1-ago-99	149.853	20% A.V.	179.824	
VALOR A INVERTIR POR VENCIMIENTO DE CAPITAL E INTERESES (A)					254.306	57.140
INCREMENTO O (DISMINUCION) DE LOS PORTAFOLIOS POR VARIACION DE LOS APORTES NETOS (B)					138.966	(158.928)
PAGO DE COMISION DE ADMINISTRACION Y GARANTIA FOGAFIN DEL MES DE JULIO DE 2002 Y TRES POR MIL DEL MES DE AGOSTO DE 2002 (C)						15.984
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	400.000	15% A.V.		432.843	
VALOR A EXCLUIR POR DISMINUCION DE LOS APORTES NETOS (D)					432.843	
VALOR A INVERTIR EL 1 DE AGOSTO DE 2002 (A+B-C+D)				393.272	315.071	

SUPERINTENDENCIA BANCARIA
DE COLOMBIA

Carta Circular No. 99 de 2002
Pág. 2

INVERSIONES EFECTUADAS EL 1 DE AGOSTO 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	1-abr-03	15% A.V.	9.05%	0%	200.000(1)	201.600(2)	290.250 315.071
TES	15-may-12	7% A.V.	7.09%	0%			
CDT	1-feb-03	8.34% P.V.	8.44%	0%			191.672
TOTAL INVERTIDO						393.272	315.071

(1) 1.568,4761 UVR (2) 1.581,0239 UVR

Cordialmente,

MARIA TERESA BALEN VALENZUELA
Superintendente Delegado
para la Seguridad Social y
Otros Servicios Financieros.

6100