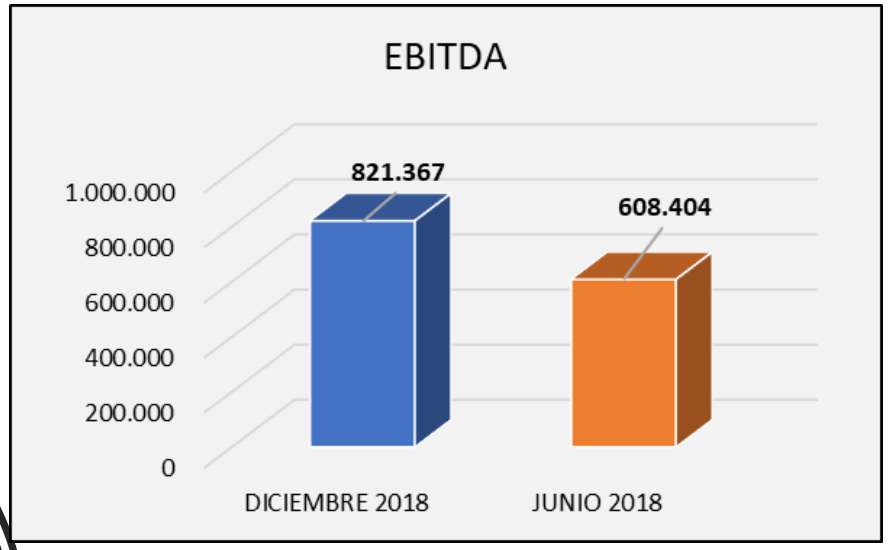
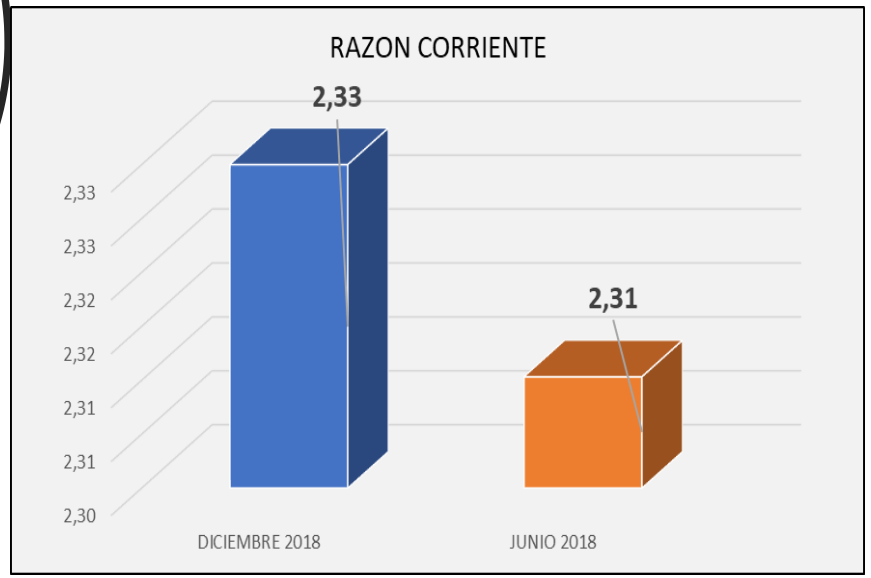
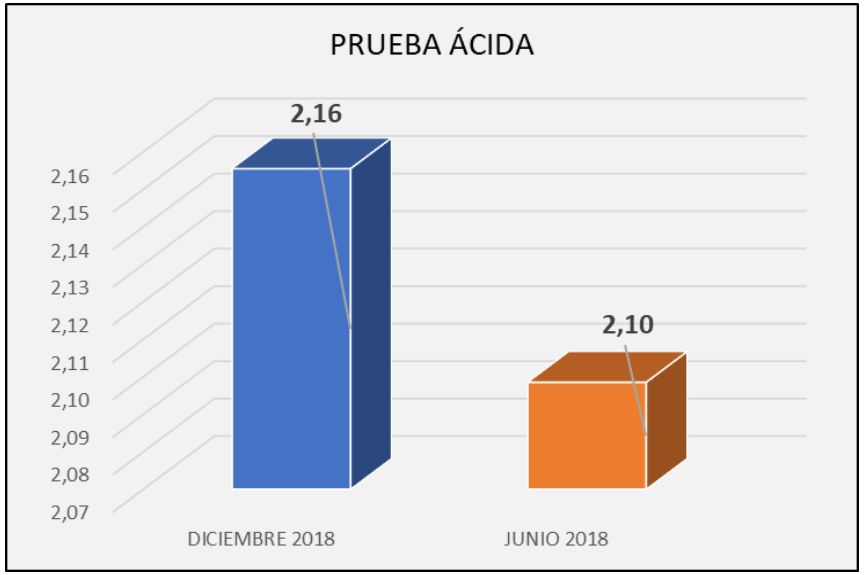
Batifruit’s S.A.S.

PORTAFOLIO DE INVERSIÓN

Algunos Indicadores…







¿POR QUÉ TOMAMOS LA DECISIÓN DE INVERTIR?

De acuerdo con los principales indicadores de liquidez, se denota un incremento considerable de estos, lo que pueden representar un exceso o concentración de cuentas del activo que podrían generar beneficios invirtiéndolos en portafolios de renta fija y variable

¿CÓMO?

EFECTIVO A 31 DE DICIEMBRE DE 2018: $1.543.231.772

- ✓ OPERACIÓN: 55% - $ 848.777.475

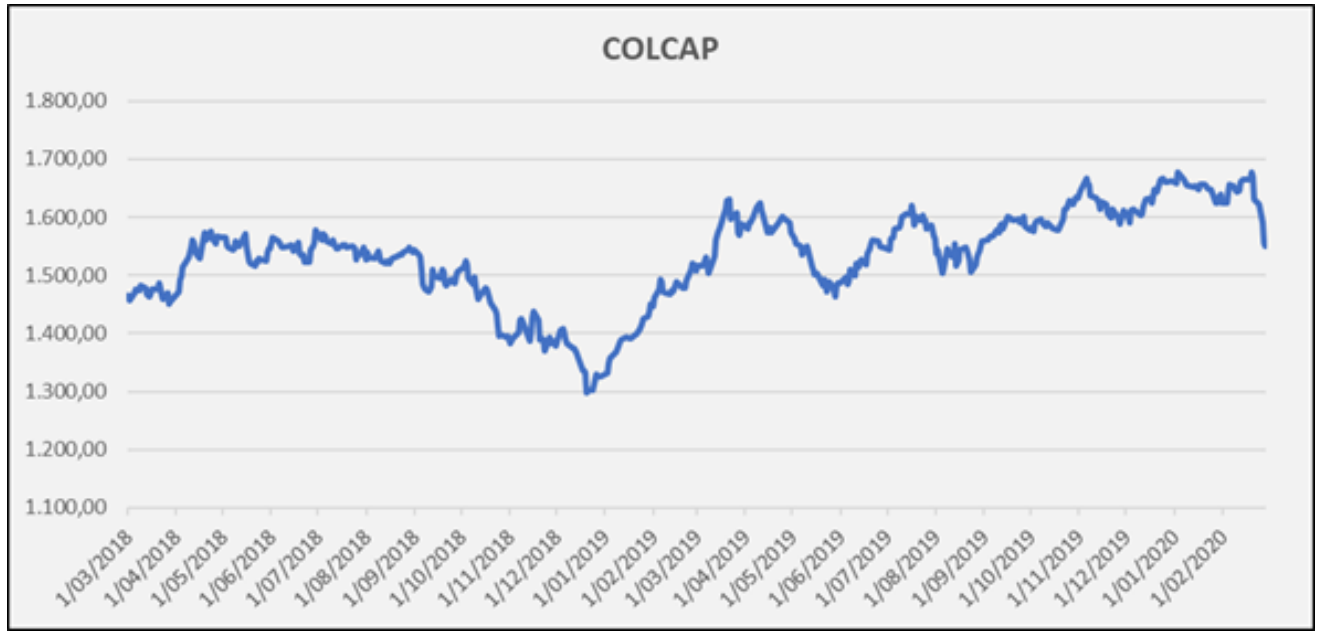
- ✓ OPORTUNIDAD DE REINVERTIR: 20% - $ 308.646.354

- ✓ PORTAFOLIO DE INVERSIÓN: 25% - $ 385.807.943
  - RENTA FIJA: 45% del valor límite – $ 173.613.574
  - RENTA VARIBALE: 55% del valor límite - $ 212.194.369

INVERSIÓN RENTA VARIABLE

Rentabilidad Total de 40,00% y Volatilidad de 1,308%,

BETA = 0,7274



Inversión Inicial

	15/02/2019	29/02/2020	31/03/2020	30/04/2020
Monto $ Colombianos	**$ 212.194.369**	**$ 240.220.040**	**$ 174.445.506**	**$ 164.264.751**
No. De Acciones	**5720**	**5720**	**5720**	**5720**

Precio de Cierre 29/02/2020 $ 42.000
Precio de Cierre 31/03/2020 $ 30.500
Precio de Cierre 30/04/2020 $ 28.720

Superavit por valorización de acciones (Mayor Valor de las acciones y cuenta de Resultados)

29/02/2020	$ 28.025.671
31/03/2020	-$ 65.774.535
30/04/2020	-$ 10.180.754

Crisis Financiera actual por Coronavirus

VAR DELTA NORMAL A 29 DE FEBRERO DE 2020

	Horizonte 1 día		Horizonte 10 día	
	Nivel Conf 95%	**Nivel Conf 99%**	**Nivel Conf 95%**	**Nivel Conf 99%**
Posicion	$ 240.220.040	$ 240.220.040	$ 240.220.040	$ 240.220.040
Volatilidad	0,0130840	0,0130840	0,0130840	0,0130840
Nivel Conf	1,65	2,33	1,65	2,33
Horizonte	1	1	3,16227766	3,16227766
VAR DELTA NORMAL	5.186.034	7.323.309	16.399.680	23.158.336
	1	2	3	4

1. La máxima pérdida posible/probable en 1 día y con un nivel de confianza de 95% es $5.186.034
2. La máxima pérdida posible/probable en 1 día y con un nivel de confianza de 99% es $7.323.309
3. La máxima pérdida posible/probable en 10 día y con un nivel de confianza de 95% es $16.399.680
4. La máxima pérdida posible/probable en 10 día y con un nivel de confianza de 99% es $23.158.336

INVERSIÓN RENTA FIJA

Inversión Certificado de Depósito a Término

Valor Nominal
$69.445.430

0,43% E.M

Fecha Emisión: 28/02/19
Fecha Venc: 31/12/20

Tasas de Mercado IBR Anual
29/02/2020 4,115%
31/03/2020 3,535%
30/04/2020 3,085%

Valoración Inversión
29/02/2020 $70.020.618
31/03/2020 $70.262.912
30/04/2020 $70.380.314

Inversión Bonos de Ecopetrol

Valor Nominal
$104.168.144

0,45% E.M

Fecha Emisión: 31/12/18
Fecha Venc: 31/12/23

Tasas de Acuerdo a los flujos de la Inversión - TIR
0,459%

Valoración Inversión
29/02/2020 $103.981.581
31/03/2020 $103.985.233
30/04/2020 $103.988.901

¿Cómo afectan el cambio en las tasas de mercado?

Duración y convexidad (valoración 29 de febrero de 2020)	
DURACIÓN MACAULAY	0,818
DURACIÓN MODIFICADA	0,815
CONVEXIDAD	0,740

Cambio en tasas de Mercado	1%	Aumento
Cambio por duración	-0,008148443	
Cambio por convexidad	0,00003698	
Sumatoria Cambios	**-0,81115%**	
Cambio Título	**$ 69.452.649**	-$ 567.969

Cambio en tasas de Mercado	-2%	Disminución
Cambio por duración	0,016296886	
Cambio por convexidad	0,00014793	
Sumatoria Cambios	**1,64448%**	
Cambio Título	**$ 71.172.094**	$ 1.151.476

GRACIAS!