

FONDO DE INVERSION SECURITY OAKTREE OPPORTUNITIES-DEBT II
 Notas a los estados financieros al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016

II. CARTERAS DE INVERSIONES

1) INVERSIONES EN VALORES O INSTRUMENTOS EMITIDOS POR EMISORES NACIONALES

Al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene inversiones en valores o instrumentos emitidos por emisores nacionales.

2) INVERSIONES EN VALORES O INSTRUMENTOS EMITIDOS POR EMISORES EXTRANJEROS

Al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016, el Fondo mantiene inversiones en valores o instrumentos emitidos por emisores extranjeros.

Al 30 de septiembre de 2017

SVS - CARTERAS DE INVERSION

INVERSIONES EN VALORES O INSTRUMENTOS EMITIDOS POR EMISORES EXTRANJEROS

Nemotécnico del instrumento	Nombre del emisor	Código país del emisor	Tipo de instrumento	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	Unidad de valorización			Valorización al cierre (2)	Código moneda liquidación	Código país de transacción	Porcentaje (1)	
						TIR, valor par o precio (1)	Código de valorización (5)	Tipo de interés (6)				del total del activo del emisor	del total del activo del fondo
OAKTREEOPFSX	OAKTREE OPPC	KY	CFE	33612354	PROM	1.4085	Precio	No aplicable	47.343	PROM	US	2,9500	0,0000
TOTAL													99,9979

Al 31 de diciembre de 2016

SVS - CARTERAS DE INVERSION

INVERSIONES EN VALORES O INSTRUMENTOS EMITIDOS POR EMISORES EXTRANJEROS

Nemotécnico del instrumento	Nombre del emisor	Código país del emisor	Tipo de instrumento	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	Unidad de valorización			Valorización al cierre (2)	Código moneda liquidación	Código país de transacción	Porcentaje (1)	
						TIR, valor par o precio (1)	Código de valorización (5)	Tipo de interés (6)				del total del activo del emisor	del total del activo del fondo
OAKTREEOPFSX	OAKTREE OPPC	KY	CFE	28995355	PROM	0.9960	Precio	No aplicable	36.701	PROM	US	3,2300	0,0000
TOTAL													99,9946

FONDO DE INVERSION SECURITY OAKTREE OPPORTUNITIES-DEBT II

Notas a los estados financieros al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016

3) INVERSIONES VALORIZADAS SEGÚN EL MÉTODO DE LA PARTICIPACIÓN

Al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene inversiones valorizadas según el método de la participación.

4) INVERSIONES EN BIENES RAICES NACIONALES Y EXTRANJEROS

Al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene inversiones en bienes raíces nacionales y extranjeros.

5) INVERSIONES EN CONTRATOS DE OPCIONES

Al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene inversiones en contratos de opciones.

6) INVERSIONES EN CONTRATOS DE FUTUROS Y FORWARDS

Al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene inversiones en contratos de futuros y forwards.

FONDO DE INVERSION SECURITY OAKTREE OPPORTUNITIES-DEBT II

Notas a los estados financieros al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016

III. OTROS INFORMES

1) CONTRATOS DE OPCIONES CUANDO EL FONDO ACTUA COMO LANZADOR

Al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene contrato de opciones cuando actúa como lanzador.

2) OPERACIONES DE VENTA CON COMPROMISO DE RETROCOMPRA (VRC) Y DE COMPRA CON COMPROMISO DE RETROVENTA (CRV)

Al 30 de septiembre de 2017 y al 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene operaciones de venta con compromiso de retrocompra y de compra con compromiso de retroventa