



FICHA TÉCNICA



DAVIVIENDA
Fiduciaria

1. SOCIEDAD ADMINISTRADORA

NOMBRE DEL FONDO

Dafuturo Multiportafolio Conserva Mayo 2021

FECHA DE CORTE :

31 10 2021
DD MM AAAA

1. CARACTERÍSTICAS DEL PORTAFOLIO

1.1. FECHA DE INICIO DE OPERACIONES:	05 05 2021 DD MM AAAA	
1.2. VALOR ADMINISTRADO (MILLONES DE PESOS):	7,803.25	
1.3. VALOR UNIDAD AL CIERRE (EN PESOS):	10,063.12	
1.4. NÚMERO DE UNIDADES EN CIRCULACION:	775,430.44	
1.5. NÚMERO DE PARTICIPES:	82	
1.6. APORTE MÍNIMO (EN PESOS):	5,000,000.0	
1.7. ADICIÓN MÍNIMA (EN PESOS):	0.0	
1.8. RETIRO MÍNIMO (EN PESOS):	0.0	
1.9. RETIRO MÁXIMO PARCIAL (NO ES UN VALOR FIJO, DEPENDE DEL SALDO DEL ENCARGO):	0.0%	
1.10. SALDO MÍNIMO (EN PESOS):	5,000,000.0	
1.11. SANCIÓN O COMISIÓN POR RETIRO ANTICIPADO (EN %):	Período	Comisión o sanción
	Fondo	< 6 meses 2%
	Portafolio (por aporte)	N.A. N.A.
1.12. PORCENTAJE DE COMISIÓN:		0.70% E.A.
1.13. BASE DE COMISIÓN:	Sobre el valor del portafolio	
1.14. PORCENTAJE DE GASTOS TOTALES DEL PORTAFOLIO:**	Al cierre del mes	Al cierre del mes anterior
	0.22%	0.22%

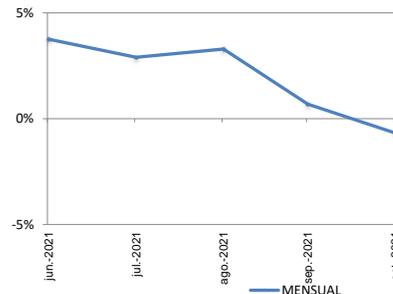
** Se calcula dividiendo el promedio mensual de los gastos totales del portafolio de los últimos 12 meses entre el promedio mensual del patrimonio para el mismo período.

3. ESTRATEGIA DE INVERSIÓN

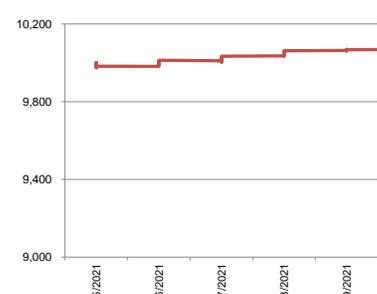
Este es un portafolio cerrado de perfil conservador que propende por preservar el capital en pesos al vencimiento de la misma, a través de la inversión en títulos de deuda o depósitos a término, en moneda local o en dólar, emitidos por emisores locales o extranjeros, calificados con grado de inversión por una sociedad calificadoradora de riesgo autorizada por la Superintendencia Financiera de Colombia. Si la inversión se realiza en dólares, se contratará cobertura completa de la moneda, con el fin de no generar exposición cambiaria. El plazo máximo de las inversiones estará asociado al plazo de la Alternativa Cerrada.

4. EVOLUCIÓN

4.1. EVOLUCIÓN DE RENTABILIDADES DESDE EL INICIO DE OPERACIONES DEL MULTIPORTAFOLIO



4.2. EVOLUCIÓN VALOR DE LA UNIDAD DESDE EL INICIO DE OPERACIONES DEL MULTIPORTAFOLIO



RENTABILIDAD EFECTIVA ANUAL DEL PORTAFOLIO AL CIERRE DEL PERÍODO REPORTADO

	Último mes	Últimos 6 meses	Último año	Últimos 2 años	Últimos 3 años
4.3. RENTABILIDAD:	-0.68%	N.D	N.D	N.D	N.D
4.4. RENTABILIDAD PROMEDIO MENSUAL:			N.D	N.D	N.D
4.5. VOLATILIDAD DE LA RENTABILIDAD MENS:			N.D	N.D	N.D

2. CALIFICACIÓN DEL PORTAFOLIO

2.1. RIESGO DE ADMINISTRACIÓN OPERACIONAL	2.2. RIESGO DE MERCADO	2.3. RIESGO DE CRÉDITO
2.4. FECHA DE LA ÚLTIMA CALIFICACIÓN DEL PORTAFOLIO :	2.5. ENTIDAD CALIFICADORA	
DD MM AAAA		

4.6. INFORMACIÓN DE MADURACIÓN Y DURACIÓN

Cálculo aplicable al portafolio de renta fija		
DETALLE DE PLAZOS	4.6.1. MADURACIÓN % DE PARTICIPACIÓN EN EL PORTAFOLIO	4.6.2. DURACIÓN % DE PARTICIPACIÓN EN EL PORTAFOLIO
1 a 180 días	0.00%	26.42%
181 a 365 días	100.00%	73.58%
1 a 3 años	0.00%	0.00%
3 a 5 años	0.00%	0.00%
Más de 5 años	0.00%	0.00%
Maduración promedio del portafolio	192.21 Días	
Duración promedio del portafolio		184.06 Días

