

INFORME DE VALORACIÓN Y ESTRUCTURA DE LOS ACTIVOS
Fondo de Inversión Abierto Renta Futuro SIVFIA-027
Administradora de Fondos de Inversión Universal, S.A.
Julio-septiembre 2020

“El presente informe tiene como propósito revelar el comportamiento del portafolio de inversión del Fondo de Inversión Abierto Renta Futuro, siendo responsabilidad del inversionista cualquier decisión de inversión que tome”.

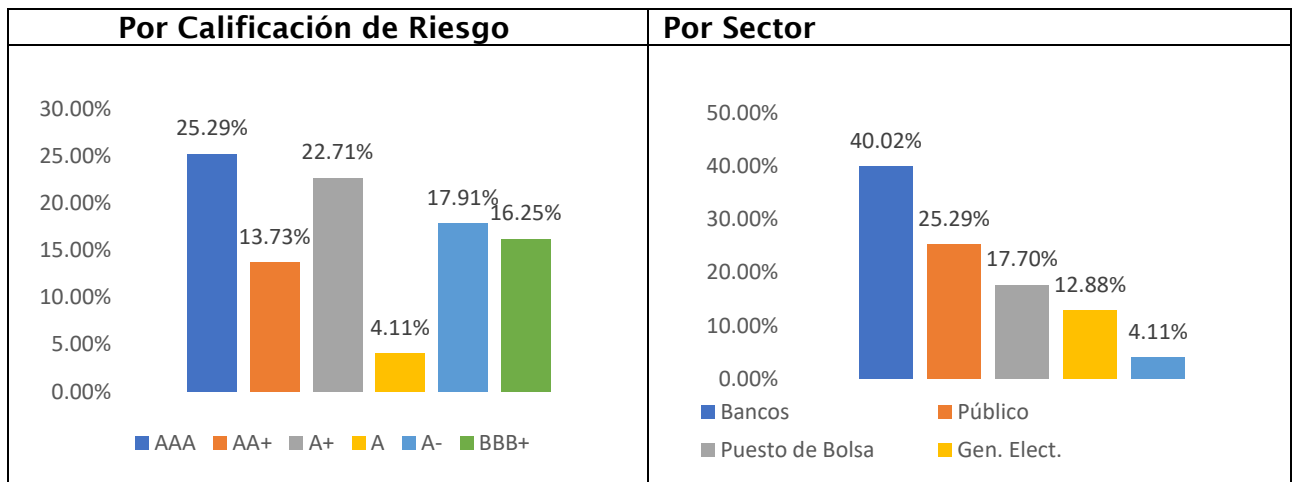
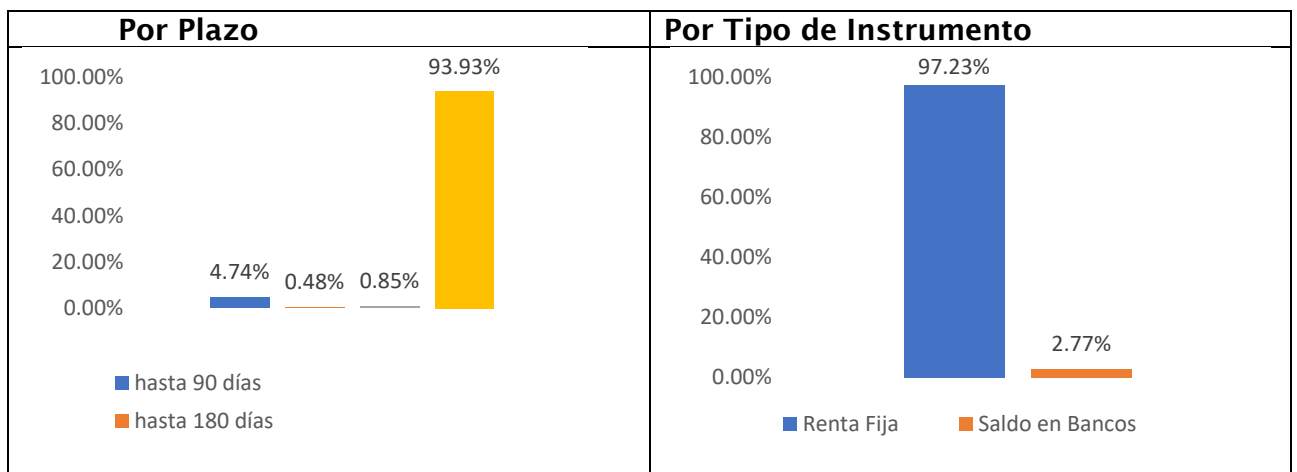
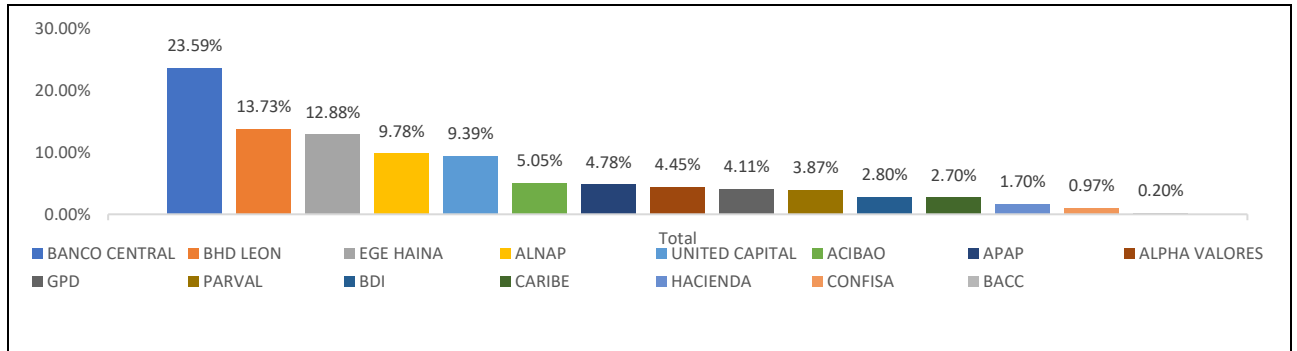
- i. Información general del fondo:** El Fondo de Inversión Abierto Renta Futuro es un Fondo de Inversión de largo plazo, que invierte predominantemente en instrumentos de renta fija calificados con “Grado de Inversión”, en Pesos Dominicanos. Su condición de objetivo de inversión en el largo plazo resulta tras su política de inversión ordenar el mantenimiento de una duración promedio ponderada mínima de sus inversiones de renta fija de mil ochenta (1,080) días. Este conjunto de condiciones establecidas por su reglamento de inversión conlleva a que este asimile una exposición moderada a riesgos de mercado, y por ende resulta ser un fondo con una exposición a riesgos: moderado

Conforme a lo determinado en el respectivo Prospecto de Inversión, el Fondo podrá invertir en **i.** Depósitos a plazo y Cuentas de ahorro o corriente en entidades financieras reguladas por la ley monetaria y financiera con calificación grado de inversión; **ii.** Valores objeto de oferta pública transados en bolsa Valores y otros mecanismos de negociación autorizados por la SIV y previamente inscritos en el Registro del Mercado de Valores y Productos; **iii.** Valores Representativos de Deuda del Sector Privado; **iv.** Otros títulos de crédito o inversión emitidos por el Ministerio de Hacienda y/o Banco Central de la República Dominicana, y en **v.** Cuotas emitidas por fondos mutuos o abiertos y fondos cerrados de inversión regidos por la Ley del Mercado de Valores, bien sea que cualquiera de estos activos este denominado en pesos dominicanos o en dólares estadounidenses.

Las entidades financieras donde invierte el Fondo son reguladas por la Ley Monetaria y Financiera y supervisadas por la Superintendencia de Bancos; los valores de oferta pública en los que invierte el Fondo se encuentran inscritos en el Registro del Mercado de Valores y Productos de la República Dominicana y son negociados a través de un mecanismo centralizado de negociación. El Fondo no cuenta con calificación de Riesgo ni tiene contratadas entidades para el servicio de distribución de cuotas.

El patrimonio del Fondo al 30 de septiembre del 2020 es de **DOP352,625,985.52**. Al ser un fondo de inversión abierto el mismo no cuenta con fecha de vencimiento.

II. Estructura de la cartera: Por Emisor



Duración Promedio Ponderada del Portafolio


La duración promedio ponderada del portafolio al cierre del periodo fue de 1,231 días, y la misma se situó durante todo el trimestre dentro del rango dispuesto por su reglamento de inversión.

Excesos a los Límites de Inversión e Inversiones No Previstas

- En fecha seis (06) de julio de 2020, se notificó presenta una duración por debajo de la duración mínima del portafolio (1,080 días), señalada por su reglamento interno del fondo al cierre del treinta (30) de junio de 2020. Dicho requerimiento fue adecuado en el cierre del veintinueve (29) de julio de 2020, y notificado oportunamente en fecha del treinta (30) de julio de 2020.
- En fecha catorce (14) de agosto de 2020, se notificó un nivel de liquidez por debajo al límite requerido por el reglamento del fondo al cierre del trece (13) de agosto de 2020. Dicho requerimiento fue adecuado en el cierre del catorce (14) de agosto de 2020, y notificado oportunamente en fecha del diecisiete (17) de agosto de 2020.
- En fecha diecinueve (19) de agosto de 2020, se notificó un nivel de liquidez por debajo al límite requerido por el reglamento del fondo al cierre del dieciocho (18) de agosto de 2020. Dicho requerimiento fue adecuado en el cierre del veinte (20) de agosto de 2020, y notificado oportunamente en fecha del veintiuno (21) de agosto de 2020.
- En fecha veinticuatro (24) de agosto de 2020, se notificó que la emisión SIVEM-105 se estableció por encima del requerido límite máximo de concentración de una misma emisión de valores de deuda 15% del patrimonio del Fondo al cierre del veintiuno (21) de agosto de 2020. Dicho requerimiento fue adecuado en el cierre del veinticuatro (24) de agosto de 2020, y notificado oportunamente en fecha del veintiséis (26) de agosto de 2020.
- En fecha primero (01) de septiembre de 2020, se notificó que la emisión SIVEM-120 se estableció por encima del requerido límite máximo de concentración de una misma emisión de valores de deuda 15% del patrimonio del Fondo al cierre del treinta y uno (31) de agosto de 2020. Dicho requerimiento fue adecuado en el cierre del quince (15) de septiembre de 2020, y notificado oportunamente en fecha del diecisiete (17) de septiembre de 2020.

III. Valoración de los activos:



 <p style="text-align: center;"><i>Sello de la sociedad</i></p>	<p>20 de octubre de 2020</p> <p style="text-align: center;"><i>Fecha de elaboración</i></p>
--	---

“La Sociedad Administradora de Fondos de Inversión Universal en nombre y representación del Fondo administrado Fondo de Inversión Abierto Renta Futuro, da fe y testimonio de que las informaciones expresadas en este documento son integra, veraces y oportunas, por tanto, son responsables frente a los aportantes y el público en general por cualquier inexactitud u omisión presentada en el contenido del presente informe.

La publicación de este informe en la página web de la Superintendencia del Mercado de Valores no implicará garantía alguna de esta, sobre la inversión efectuada en un fondo de inversión o la calidad de sus cuotas de participación”.