

# FICHA TÉCNICA

NOTA S&P  
EUROPE 350

ENERO 31 DE 2021

## Características del Portafolio

|  |             |
|--|-------------|
| Fecha de inicio de Operaciones         | 2016-05-03  |
| Valor Administrado (Millones de Pesos) | 6058,14     |
| Valor de unidad al cierre (pesos)      | 13440,55    |
| Número de Unidades                     | 450735,7825 |
| Número de Partícipes                   | 88          |
| Aporte Mínimo                          | 10.000.000  |
| Adición Mínima                         | 10.000.000  |
| Retiro Mínimo                          | No Hay      |
| Retiro Máximo Parcial                  | No Hay      |
| Saldo Mínimo                           | No Hay      |

| Sanción o Comisión por Retiro Anticipado                      | Periodo                                   | Comisión               | Sanción |
|---|---|------------------------|---------|
|   |   | Fond.                  | Port.   |
|   | < año 2021                                | No se permiten retiros |         |
|   | 3 a 6 meses                               | 0%                     | 0%      |
|   | 7 a 12 meses                              | 0%                     | 0%      |
|   | > 1 año                                   | 0%                     | 0%      |
| Porcentaje de Comisión  | 2% EA                                     |                        |         |
| Base de Comisión  | Cálculo diario, sobre el valor del fondo. |                        |         |
| Porcentaje de gastos totales del portafolio al cierre de mes. | 0,1652%                                   |                        |         |

## Calificación

|  |         |
|--|---------|
| Riesgo de Administración y Operacional | Ninguno |
| Riesgo de Mercado                      | Ninguno |
| Riesgo de Crédito                      | Ninguno |
| Fecha de Última Calificación           | Ninguno |
| Entidad Calificadora                   | Ninguno |

## Estrategias de Inversión

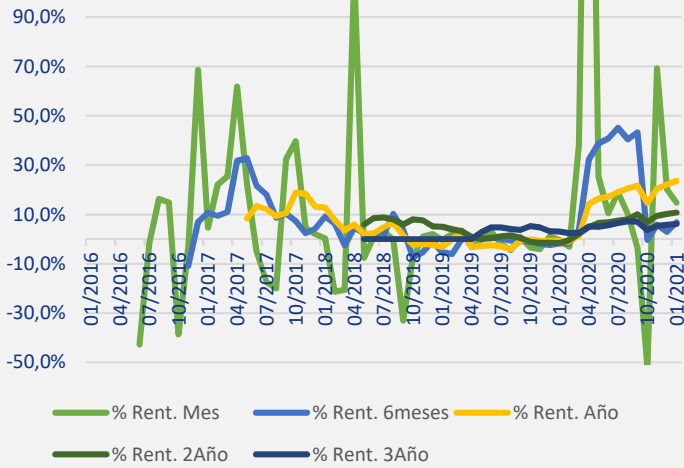
El portafolio S&P Europe 350 está dirigido a aquellos partícipes con un perfil de riesgo dinámico y un horizonte de inversión a 5 años. Es un instrumento de renta fija senior unsecured, de capital protegido y una estrategia de compra y venta de opciones call sobre el índice S&P Europe 350 Low Volatility, limitando la utilidad hasta un 30%. La liquidez de este portafolio se administrará en cuentas de ahorro, corrientes y/o FIC's.

Fondo Voluntario  
de Pensiones

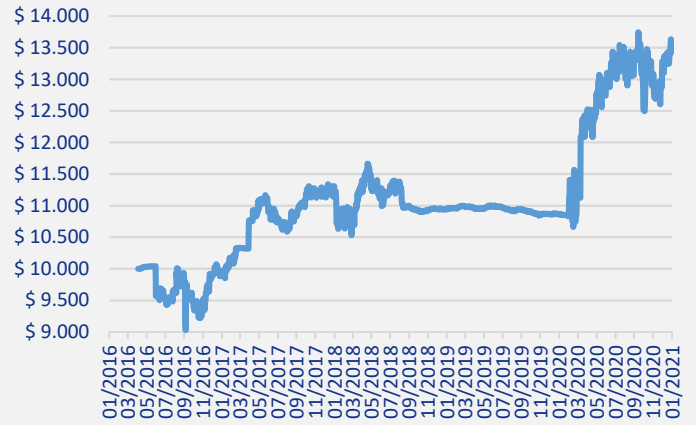
ADMINISTRADO POR  
ALLIANZ SEGUROS DE VIDA S.A.

## Evolución

Rentabilidad Últimos Años



Valor de Unidad Últimos Años



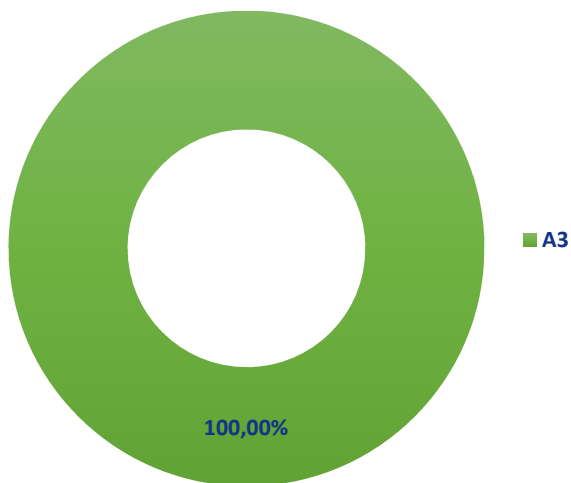
## Rentabilidad efectiva Anual del Portafolio al Cierre del Periodo Reportado

|                                   | Último mes | Últimos 6 meses | Último año | Últimos 2 años | Últimos 3 años |
|-----------------------------------|------------|-----------------|------------|----------------|----------------|
| Rentabilidad                      | 14,73%     | 6,87%           | 23,65%     | 10,76%         | 6,18%          |
| Rentabilidad promedio mensual     |            |                 | 37,21%     | 18,30%         | 12,87%         |
| Volatilidad rentabilidad mensual. |            |                 | 86,77%     | 63,07%         | 55,38%         |

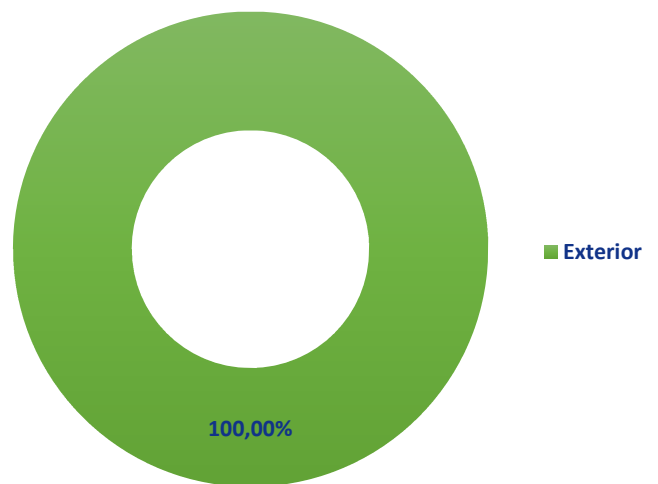
| Detalle de Plazos               | Maduración (% de part. en el portafolio) | Duración (% de part. en el portafolio) |
|---------------------------------|--|--|
| 1 a 180 días                    | 100%                                     | 100%                                   |
| 181 a 365 días                  | 0%                                       | 0%                                     |
| 1 a 3 años                      | 0%                                       | 0%                                     |
| 3 a 5 años                      | 0%                                       | 0%                                     |
| Mas de 5 años                   | 0%                                       | 0%                                     |
| Maduración Prom. del Portafolio | 116 días                                 |  |
| Duración Prom. del Portafolio   |  | 116 días                               |

## Evolución

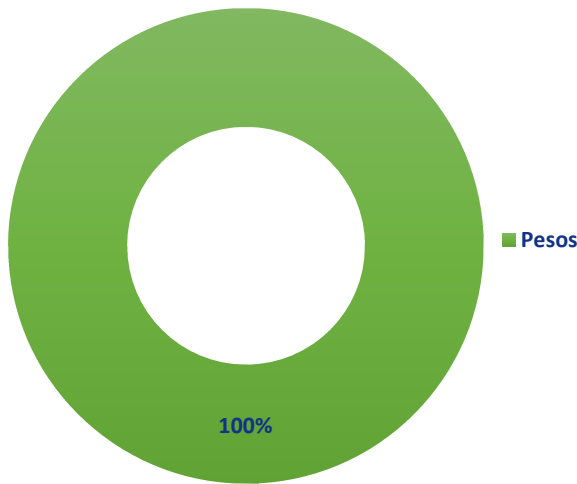
Distribución del Portafolio por Calificación



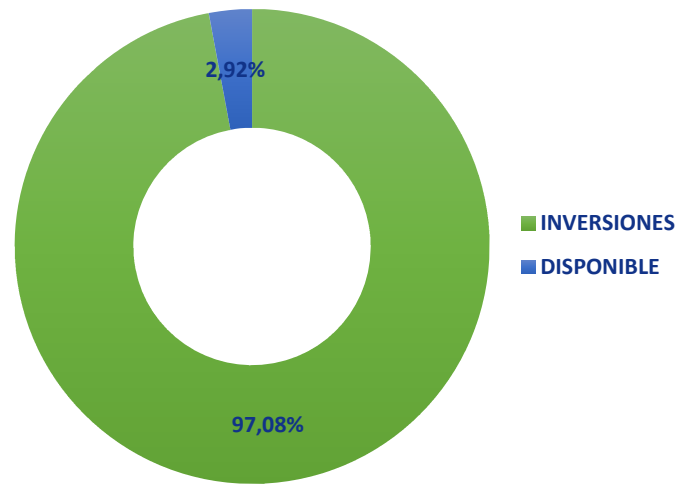
Distribución del portafolio por sector



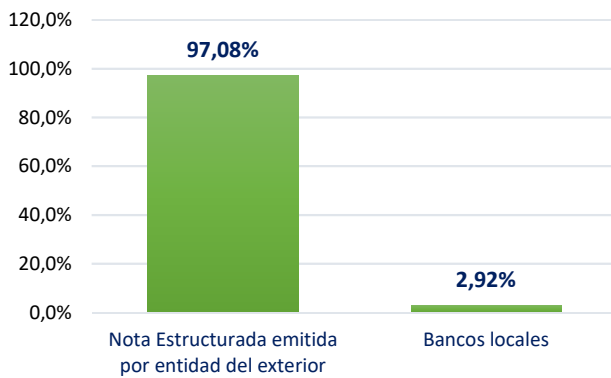
### Distribución del Portafolio por Tipo de Moneda



### Composición del Activo del Portafolio



### Distribución del Portafolio por Tipo de Inversión



### Principales Inversiones del Portafolio

| EMISOR              | PARTICIPACIÓN |
|---------------------|---------------|
| BBVA GLOBAL MARKETS | 97,08%        |
| SUDAMERIS           | 2,92%         |

### Hoja de Vida del Administrador del Portafolio

|                         |  |
|-------------------------|--|
| Nombre                  | Pedro Miguel Flórez Alvarado   |
| Profesión               | Administrador de Empresas, Especialista en negocios Internacionales con Énfasis en Mercado de Capitales. |
| Experiencia             | Administrador de Portafolios Allianz, con 15 años de experiencia.  |
| Otros Fondos a su Cargo | Allianz Seguros de Vida S.A., Allianz Seguros S.A., Fondo Voluntario de Pensiones                        |

### Revisor Fiscal del Fondo Voluntario de Pensiones

|                               |                                       |
|-------------------------------|---------------------------------------|
| Nombre                        | Edgar Augusto Pedraza                 |
| Firma o Entidad               | PricewaterhouseCoopers Ltda.          |
| Dirección                     | Calle 100 No 11ª-35 Piso 5            |
| Teléfono y Correo Electrónico | (57-1) 634 0555. Fax: (57-1) 218 8544 |

El Revisor fiscal es el mismo de la administradora

### Defensor del Consumidor Financiero

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| Nombre                        | Jose Federico Ustáriz González                          |
| Firma o Entidad               | Ustariz & Abogados                                      |
| Dirección                     | Cra 11ª # 96-51 Ofi 203                                 |
| Teléfono y Correo Electrónico | 6108161-6108164 / defensoriaallianz@ustarizabogados.com |