

FONDO DE INVERSIÓN LARRAINVIAL QUANT LATAM

Serie: I

Administradora: LARRAINVIAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRADORA GENERAL DE FONDOS S.A.

Fecha: 30 de Septiembre de 2020

LarrainVial
ASSET MANAGEMENT

Objetivo de Inversión

El objeto del Fondo es invertir en instrumentos de capitalización del mercado de valores latinoamericano. El Fondo utilizará métodos cuantitativos para mantener una exposición a los mercados latinoamericanos a través de la inversión basada en factores fundamentales como Momento, Calidad y Valor. Se utilizarán modelos cuantitativos administrando la liquidez, diversificación y riesgo del portafolio.

Riesgo



Horizonte de Inversión Recomendado: > 3 años

Información del Fondo

Fecha de Inicio	13 de Junio de 2018
Portfolio Manager	Martin Oksenberg
Co-Portfolio Manager	Yosy Banach
Estructura Legal	Fondo de Inversión Rescatable
Patrimonio del Fondo	USD 6.344.368
Domicilio	Chile
Moneda	Dólar
Beneficios Tributarios	-
Índice de Referencia	-
Ticker Bloomberg	-
Ticker Índice Referencia	-
Audidores	KPMG
Clasificación de riesgo	-
Dividendos	Se distribuirá anualmente como dividendos un 100 % de los beneficios netos percibidos por el fondo durante el ejercicio.

Negociación y Precios

Serie	I
Monto Mínimo	1.000 MM CLP
Tipo de Fondo	Rescatable
Comisión de Administración	Hasta 1,0% IVA Incluido
Comisión por Éxito	-
Plazo Pago Rescates	15 días corridos
Tasa Anual de Costos	1.8%

Comentario Portfolio Manager - Martin Oksenberg - Yosy Banach

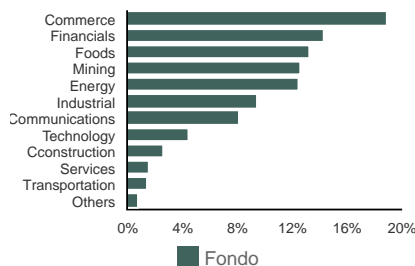


Evolución del Valor Cuota (Desde: 13-06-2018 - Hasta: 30-09-2020)

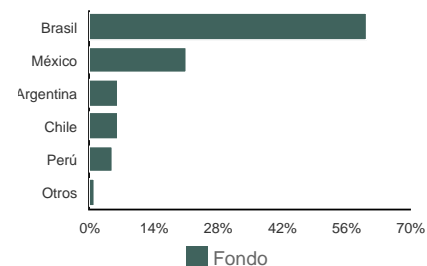


Rentabilidad Nominal	1 Mes	3 Meses	6 Meses	1 Año	YTD
Serie I	-5,61%	-2,34%	5,87%	-38,89%	-44,29%

Composición por Sector (% del Activo)



Composición por País (% del Activo)



10 Principales Emisores

Emisor	% de la Cartera
Vale do rio doce	8,5%
America movil s.a.	6,5%
Magazine luiza sa	5,1%
Bvmf	4,4%
Petrobras global fin	4,3%
Mercado libre inc	4,0%
Southern peru copper	2,8%
Gruma sab de cv	2,5%
Equatorial energia s	2,5%
Banco bradesco	2,4%

Estadísticas del Fondo

Número de Emisores	62
Número de Meses Positivos	13
Número de Meses Negativos	14
	3M 6M 1Y
	Fondo Ref.* Fondo Ref.* Fondo Ref.*
Volatilidad (%)	25,2 -- 34,9 -- 44,1 --
Sharpe Ratio	-- -- -- -- --
Tracking Error ex-post (%)	-- -- --
VAR (95%) (%)	41,5 -- 57,5 -- 72,6 --
Info. Ratio	-- -- --

* Índice Referencia