

FONDO DE INVERSIÓN LARRAINVIAL QUANT LATAM

Serie: O

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

Fecha: 30 de Septiembre de 2020

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	17 de Abril de 2020
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	O
Monto Mínimo	350 MM CLP
Tipo de Fondo	Rescatable
Comisión de Administración	Hasta 1,8% IVA Incluido
Comisión por Éxito	-
Plazo Pago Rescates	15 días corridos
Tasa Anual de Costos	0.0%

Comentario Portfolio Manager - Martin Oksenberg - Yosy Banach

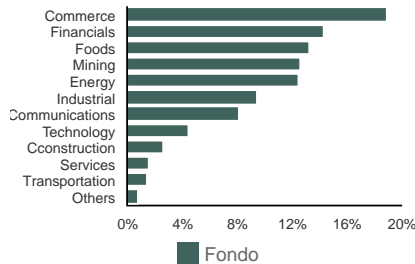


Evolución del Valor Cuota (Desde: 17-04-2020 - Hasta: 30-09-2020)

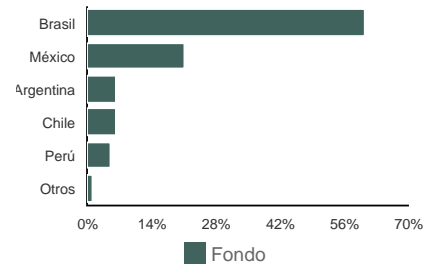


Rentabilidad Nominal	1 Mes	3 Meses	6 Meses	1 Año	YTD
Serie O	-5,67%	-2,52%	-	-	-

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	2
Número de Meses Negativos	3
	3M 6M 1Y
	Fondo Ref.* Fondo Ref.* Fondo Ref.*
Volatilidad (%)	25,2 -- -- -- --
Sharpe Ratio	-- -- -- -- --
Tracking Error ex-post (%)	-- -- -- -- --
VAR (95%) (%)	41,5 -- -- -- --
Info. Ratio	-- -- -- -- --

* Índice Referencia