



#### ANTECEDENTES GENERALES

Nombre del Fondo Mutuo : FONDO MUTUO ZURICH ESTRUCTURADO NOMINAL  
Tipo de Fondo Mutuo : De Acuerdo a su política de inversión, este es un FONDO MUTUO ESTRUCTURADO, 7-FM ESTRUCTURADO, SUBTIPO 6  
Nombre de la Sociedad Administradora : Zurich Chile Asset Management Administradora General de Fondos S.A  
Serie de Cuotas : Series A-B-APV/APVC-D-W-W-APV-Z  
Fecha de la Cartera de Inversiones : 30 de Septiembre de 2023  
Moneda en la cual se lleva la contabilidad del fondo : PESOS

#### ANTECEDENTES DE LA CARTERA DE INVERSIONES

|                                                              | Valor de la Inversión<br>(Miles de \$) | % del Activo del Fondo |
|--------------------------------------------------------------|----------------------------------------|------------------------|
| <b>Instrumentos de deuda de emisores nacionales</b>          |                                        |                        |
| Bonos de bancos e instituciones financieras                  |                                        |                        |
| Financiero                                                   | 1.081.606                              | 9,53                   |
| Depósitos y/o pagarés de bancos e instituciones financieras  |                                        |                        |
| Financiero                                                   | 8.296.474                              | 73,09                  |
| Otros Productos y Servicios                                  | 676.936                                | 5,96                   |
| <b>TOTAL DE Instrumentos de deuda de emisores nacionales</b> | <b>10.055.016</b>                      | <b>88,58</b>           |
| <b>SIN CLASIFICACION</b>                                     |                                        |                        |
| BE                                                           |                                        |                        |
| OTROS                                                        | 693.545                                | 6,11                   |
| Otros Productos y Servicios                                  | 597.294                                | 5,26                   |
| <b>TOTAL DE SIN CLASIFICACION</b>                            | <b>1.290.839</b>                       | <b>11,37</b>           |
| <b>TOTAL CARTERA DE INVERSIONES</b>                          | <b>11.345.855</b>                      | <b>99,96</b>           |
| <b>OTROS ACTIVOS</b>                                         | <b>4.929</b>                           | <b>0,04</b>            |
| <b>TOTAL ACTIVOS</b>                                         | <b>11.350.784</b>                      | <b>100,00</b>          |
| <b>TOTAL PASIVOS</b>                                         | <b>54.404</b>                          |                        |
| <b>TOTAL PATRIMONIO</b>                                      | <b>11.296.380</b>                      |                        |

#### Clasificación de Riesgo de los Activos

- a) Los instrumentos de deuda de la cartera emitidos por el Estado de Chile o el Banco Central de Chile representan un 0.00 % del total del activo del fondo.
- b) Los instrumentos de la cartera que cuentan con clasificación de riesgo de categoría AAA,AA+,AA-,AA o N-1 representan un 94.69 % del total del activo del fondo.
- c) Los instrumentos de la cartera que cuentan con clasificación de riesgo de categoría A,A+,A- o N-2 representan un 5.26 % del total del activo del fondo.
- d) Los instrumentos de la cartera que cuentan con clasificación de riesgo de categoría BBB o N-3 representan un 0.00 % del total del activo del fondo.
- e) Los instrumentos de la cartera que cuentan con clasificación de riesgo de categoría BB, B o N-4 representan un 0.00 % del total del activo del fondo.
- f) Los instrumentos de la cartera que cuentan con clasificación de riesgo de categoría C o D representan un 0.00 % del total del activo del fondo.
- g) Los instrumentos de la cartera que cuentan con clasificación de riesgo de categoría E o N-5 representan un 0.00 % del total del activo del fondo.
- h) Los instrumentos de la cartera que no cuentan con clasificación de riesgo representan un 0.00 % del total del activo del fondo.
- i) Los instrumentos de la cartera que cuentan con clasificación de riesgo distinta de las anteriores representan un 0.00 % del total del activo del fondo.

#### OPERACIONES DE PRODUCTOS DERIVADOS

##### a) Contratos de Futuro de Compra o de Venta

| Monto Comprometido<br>(\$M) | Valor de mercado<br>de los Contratos<br>(\$M) |
|-----------------------------|-----------------------------------------------|
| -                           | -                                             |

##### b) Contratos de Forward de Compra o de Venta

| Monto Comprometido<br>(\$M) | Valor de mercado<br>de los Contratos<br>(\$M) |
|-----------------------------|-----------------------------------------------|
| -                           | -                                             |

##### c) Contratos de Opciones de Compra o de Venta

| Valor total de Contratos<br>a Precio de Ejercicio<br>(\$M) | Valor total de Contratos<br>a precio de mercado<br>(\$M) |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| -                                                          | -                                                        |

##### d) Contratos de Opciones en que el Fondo Mutuo actúa como lanzador (Compra o Venta)

| Valor total de Contratos<br>a Precio de Ejercicio<br>(\$M) | Valor total de Contratos<br>a precio de Mercado<br>(\$M) | Monto Comprometido<br>Sobre el Activo del Fondo<br>(%) |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|
| -                                                          | -                                                        | -                                                      |

##### e)

| Valor comprometido en<br>Márgenes<br>(\$M) | Porcentaje sobre<br>Activo<br>(%) |
|--------------------------------------------|-----------------------------------|
| -                                          | -                                 |

#### Composición de la Cartera de Renta Fija según Plazo al Vencimiento y su Duración

- a) Los instrumentos de deuda con plazo al vencimiento menor o igual a 365 días representan un 99.95 % del total del activo del fondo.
- b) Los instrumentos de deuda con plazo al vencimiento mayor a 365 días representan un 0.00 % del total del activo del fondo.
- c) La duración de la cartera de los instrumentos de deuda del fondo es de 151,4034 días.

Nota : se entenderá por "duración de un instrumento", el promedio ponderado de los vencimientos de sus flujos de caja (cupones y principal), donde los ponderadores son el valor presente de cada flujo como proporción el precio del instrumento y por "duración de la cartera de inversiones", el promedio ponderado de los instrumentos componentes de dicha cartera.

#### RENTABILIDAD DEL FONDO

Rentabilidades para las cuotas que permanecieron todo el periodo sin ser rescatadas

| Rentabilidad            | Ultimo Mes | Ultimo Trimestre |          | Ultimos 12 Meses |          | Ultimos 3 Años |          |
|-------------------------|------------|------------------|----------|------------------|----------|----------------|----------|
|                         |            | Acumulada        | Promedio | Acumulada        | Promedio | Acumulada      | Promedio |
| <b>SERIE A</b>          |            |                  |          |                  |          |                |          |
| REAL                    | 0,45%      | 2,17%            | 0,72%    | 4,44%            | 0,36%    | NA             | NA       |
| NOMINAL                 | 0,64%      | 2,47%            | 0,82%    | 10,35%           | 0,82%    | NA             | NA       |
| <b>SERIE B-APV/APVC</b> |            |                  |          |                  |          |                |          |
| REAL                    | 0,45%      | 2,17%            | 0,72%    | 4,44%            | 0,36%    | NA             | NA       |
| NOMINAL                 | 0,64%      | 2,47%            | 0,82%    | 10,35%           | 0,82%    | NA             | NA       |
| <b>SERIE D</b>          |            |                  |          |                  |          |                |          |
| REAL                    | 0,00%      | NA               | NA       | NA               | NA       | NA             | NA       |
| NOMINAL                 | NA         | NA               | NA       | NA               | NA       | NA             | NA       |
| <b>SERIE W</b>          |            |                  |          |                  |          |                |          |
| REAL                    | 0,48%      | 2,25%            | 0,74%    | 4,75%            | 0,39%    | NA             | NA       |
| NOMINAL                 | 0,67%      | 2,55%            | 0,84%    | 10,68%           | 0,85%    | NA             | NA       |
| <b>SERIE W-APV</b>      |            |                  |          |                  |          |                |          |
| REAL                    | 0,00%      | NA               | NA       | NA               | NA       | NA             | NA       |
| NOMINAL                 | NA         | NA               | NA       | NA               | NA       | NA             | NA       |
| <b>SERIE Z</b>          |            |                  |          |                  |          |                |          |
| REAL                    | 0,52%      | 2,37%            | 0,78%    | 5,75%            | 0,47%    | NA             | NA       |
| NOMINAL                 | 0,71%      | 2,68%            | 0,88%    | 11,73%           | 0,93%    | NA             | NA       |
| Variación UF            | 0,19%      | 0,30%            | 0,10%    | 5,66%            | 0,46%    | 26,09%         | 0,65%    |

NA, no aplicable, la fecha de inicio de operaciones de la serie no cumple con el periodo para realizar el cálculo correspondiente.  
Las rentabilidades o ganancias obtenidas en el pasado por este fondo, no garantiza que ellas se repitan en el futuro.  
Los valores de las cuotas de los fondos mutuos son variables.



#### **CARGOS EFECTUADOS AL FONDO**

##### Remuneración de la sociedad administradora

a) La remuneración fija de la sociedad administradora establecida en el reglamento interno del fondo es la siguiente:

- Para la Serie A es de un 0,8%
- Para la Serie B-APV/APVC es de un 0,8%
- Para la Serie D es de un 0,60%
- Para la Serie W es de un 0,50%
- Para la Serie W-APV es de un 0,60%
- Para la Serie Z es de un 0,01%

- La remuneración variable establecida en el reglamento interno del fondo es la siguiente:

- Para la Serie A es de un 0,0%
- Para la Serie B-APV/APVC es de un 0,0%
- Para la Serie D es de un 0,0%
- Para la Serie W es de un 0,00%
- Para la Serie W-APV es de un 0,0%
- Para la Serie Z es de un 0,0%

b) La remuneración fija devengada a favor de la sociedad administradora durante el último trimestre es la siguiente:

- Para la Serie A es de un 0,8% del patrimonio, anualizado.
- Para la Serie B-APV/APVC es de un 0,8% del patrimonio, anualizado.
- Para la Serie D es de un 0,00%
- Para la Serie W es de un 0,50% del patrimonio, anualizado.
- Para la Serie W-APV es de un 0,0%
- Para la Serie Z es de un 0,01% del patrimonio, anualizado.

- La remuneración variable devengada a favor de la sociedad administradora durante el último trimestre es la siguiente:

- Para la Serie A es de un 0,0%
- Para la Serie B-APV/APVC es de un 0,0%
- Para la Serie D es de un 0,0%
- Para la Serie W es de un 0,00%
- Para la Serie W-APV es de un 0,0%
- Para la Serie Z es de un 0,0%

##### Gastos de operación

a) Los gastos de operación atribuibles al fondo, conforme a lo establecido en el reglamento interno son 2%

B) Los gastos de operación cargados al fondo durante el último trimestre alcanzaron a un 0%

C) Los gastos en los cuales se incurrió fueron: 0%

##### Comisiones de colocación

a) La comisión de colocación de cuotas cobradas a los partícipes, según reglamento interno, es la siguiente:

Comisión según permanencia:

- Para la Serie A es de un 0,0% Sin Comisión
- Para la Serie B-APV/APVC es de un 0,0% Sin Comisión
- Para la Serie D es de un 0,0% Sin Comisión
- Para la Serie W es de un 0,00% Sin Comisión
- Para la Serie W-APV es de un 0,0% Sin Comisión
- Para la Serie Z es de un 0,0% Sin Comisión

##### Otra Información

Para una mayor información sobre los cargos y las comisiones de colocación por fondo o para cada serie de cuotas, según corresponda, el partícipe puede informarse al respecto en el reglamento interno del fondo y/o en los estados financieros del mismo.

<< Infórmese acerca de la estructura de comisiones del fondo en el reglamento interno y en la solicitud de inversión del fondo >>