

Administradora	RUN	Moneda	Patrimonio Serie	Monto Mínimo
DATASSET ADMINISTRADORA DE FONDOS S.A.	9476	USD	\$ 100.000.000	No tiene

### Objetivo del Fondo

El objetivo de los portafolios presentados en el documento es otorgar alternativas confiables de inversión a largo plazo con distintos grados de aversión al riesgo, a través de carteras diversificadas por instrumentos de capitalización de empresas que están entre las 100 de mayor tamaño en la bolsa de Estados Unidos (S&P 100).

### Inversionista

Personas naturales y jurídicas que se caracterizan por tener un perfil medio de tolerancia al riesgo, o que utilicen este fondo como parte de un portafolio diversificado.

**Tolerancia al riesgo:** Alta  
**Horizonte de Inversión:** Desde 1 año en adelante  
**Uso de los recursos:** Inversiones financieras

### Rescates

**Fondo rescatable:** Si  
**Plazo rescate:** 30 días seguidos  
**Duración:** Indefinido

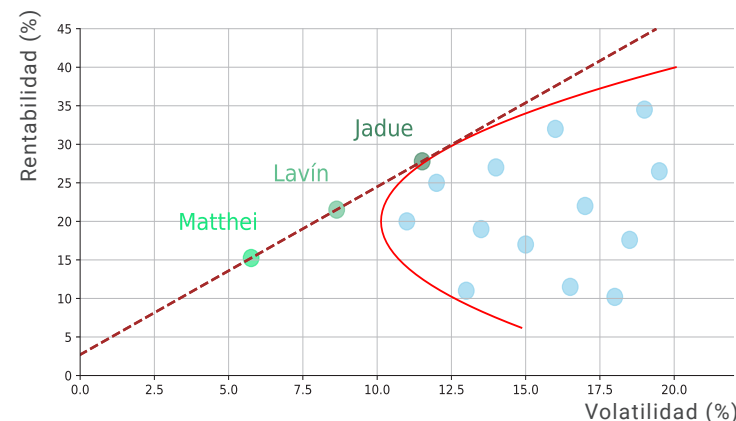
### Riesgos Asociados

- |   |   |   |
|---|---|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> Mercado         | <input type="checkbox"/> Liquidez             | <input checked="" type="checkbox"/> Sectorial |
| <input checked="" type="checkbox"/> Moneda          | <input checked="" type="checkbox"/> Derivados | <input checked="" type="checkbox"/> Créditos  |
| <input checked="" type="checkbox"/> Tasa de Interés |   |   |

### Composición del portafolio

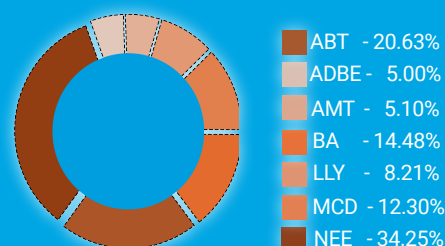
Abbott Laboratories	ABT - 20.63%
Adobe	ADBE - 5.00%
American Tower	AMT - 5.10%
Boeing Copany	BA - 14.48%
Eli Lilly and Company	LLY - 8.21%
McDonald's Corp	MCD - 12.30%
NextEra Energy	NEE - 34.25%

Indicador	Diario	Anual
Rentabilidad	0.110%	27.795%
Volatilidad	0.726%	11.517%
Ratio de Sharpe	0.1373	2.1789



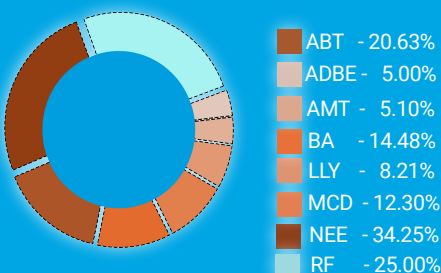
Para escoger nuestros portafolios se utiliza optimización de manera recursiva, un modelo eficiente que nos permite evaluar una mayor cantidad de combinaciones posibles que otros métodos más convencionales. Los activos a invertir están compuestos por siete acciones que representan la industria de inversión inmobiliaria, tecnología, energética, farmacéutica, comida rápida y fabricación de aeronaves.

### Asignación Jadue (Riesgo)



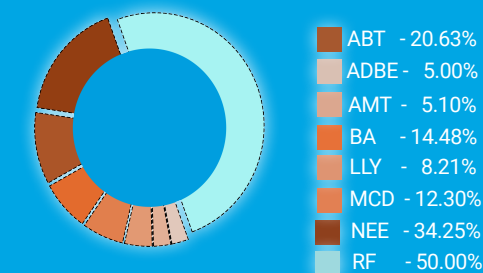
Indicador	Diario	Anual
Rentabilidad	0.110%	27.795%
Volatilidad	0.726%	11.517%
Ratio de Sharpe	0.1373	2.1789

### Asignación Lavín (Moderado)



Indicador	Diario	Anual
Rentabilidad	0.085%	21.521%
Volatilidad	0.544%	8.638%
Ratio de Sharpe	0.1373	2.1789

### Asignación Matthei (Conservador)



Indicador	Diario	Anual
Rentabilidad	0.061%	13.903%
Volatilidad	0.363%	5.759%
Ratio de Sharpe	0.1373	2.1789

Contentos y Tapizados Administradora de fondos S.A., es regulada y fiscalizada por la nueva Comisión para el Mercado Financiero (CMF), en conjunto con el Banco Central de Chile. La rentabilidad histórica de este fondo no garantiza que el comportamiento sea similar en el futuro. Antes de realizar una inversión, se recomienda leer en detalle las características de este fondo de inversión y sus riesgos asociados. La información proporcionada por esta Administradora se encuentra en las bases de información pública de la CMF ([www.cmfchile.cl](http://www.cmfchile.cl)). AGB Administradora General de Fondos S.A. no asume responsabilidades por las decisiones adoptadas por los inversionistas.

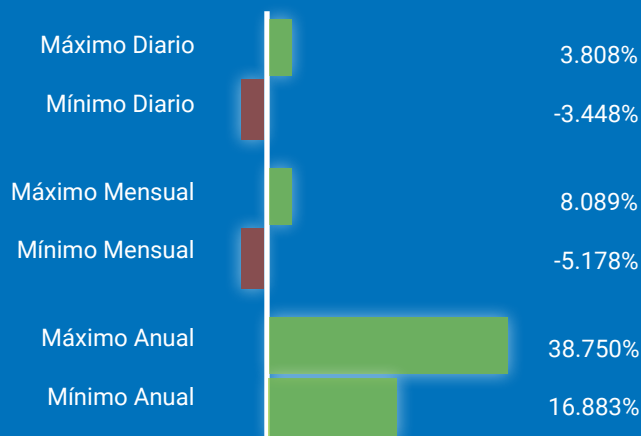
# Análisis Técnico

## Mejores y Peores Rendimientos

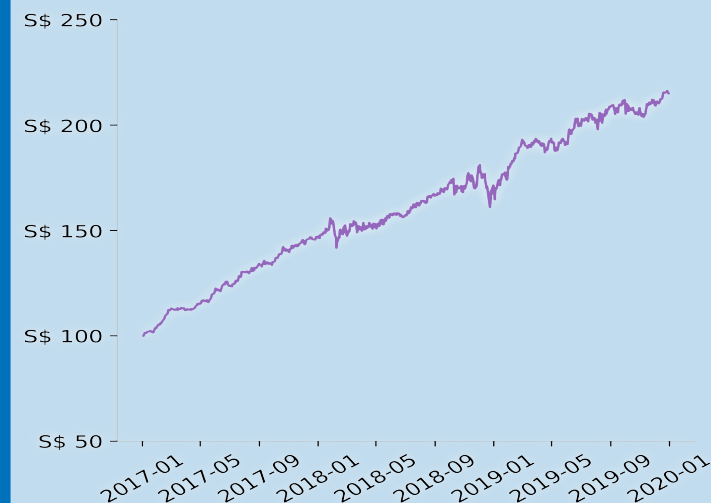
A continuación exponemos los mejores y peores rendimientos de nuestro portafolio más riesgos en términos diarios, mensuales y anuales.

### Var diario - Nivel de significancia 1 %

VaR (MMUS\$)	Asignación		
	Jadue	Lavin	Matthei
Paramétrico	2.016	1.509	0.749
Histórico	1.575	1.178	0.584
Cornish-Fisher	1.945	1.456	0.723



### Simulador US\$100: Inversión hace 3 años



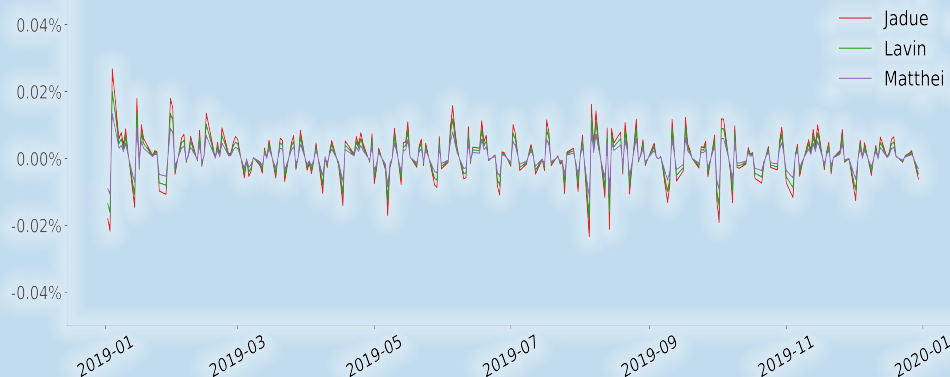
## Comentario del Manager

Si hace 3 años hubiera depositado US \$100 en nuestro fondo de inversión, hoy tendría acumulado US \$214, es decir cerca del 114% de utilidad en los últimos años.

No tenemos la política de apostar a las corazonadas para escoger nuestros portafolios, puesto que trabajamos con expertos en análisis financiero y modelamiento matemático, sobreponiendonos así a la volatilidad en los mercados generada por la incertidumbre de la guerra comercial entre Estados Unidos y China, la cual no da espacio a especulaciones; y es por eso que Contentos y Tapizados se preocupa por su bienestar económico y su tranquilidad a la hora de invertir.

La gama de opciones que tenemos le permitirán optar por el horizonte de inversión acorde a su aversión al riesgo, con bajas pérdidas máximas esperadas como nos muestra nuestro análisis VaR al 99% (Solo 2.06MM US\$ según VaR paramétrico para nuestro portafolio mas riesgoso) y un sustento matemático y técnico que asegura precisión. Porque las simulaciones y las proyecciones lo avalan, invierta seguro, invierta a largo plazo, invierta en Contentos y Tapizados.

### Backtesting - Periodo: 01/01/2019 hasta 31/12/2019



Su inversión está en buenas manos con Cyt; realizamos periódicamente un testeo del comportamiento general de todos nuestros portafolios para analizar su comportamiento; aquí se puede apreciar el Backtesting para el periodo comprendido entre el 1 de enero y el 31 de diciembre de 2019.

Se observa en el último año una volatilidad diaria en el portafolio a nivel general, la cual se debe a la creciente tensión en el mercado generada por la guerra comercial entre Estados Unidos y China.