

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Financieros al 31 de diciembre de 2019 y 2018

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

CONTENIDO

Informe del auditor independiente

Estados de situación Financiera

Estados de resultados integrales

Estados de cambios en el patrimonio neto

Estados de flujos de efectivo

Notas a los estados financieros

Anexos complementarios a los estados financieros

M\$ : Cifras expresadas en miles de pesos chilenos



## INFORME DEL AUDITOR INDEPENDIENTE

Santiago, 25 de marzo de 2020

A los Señores Aportantes  
Fondo de Inversión Zurich Renta Fija Chile Index Fund

Hemos efectuado una auditoría a los estados financieros adjuntos de Fondo de Inversión Zurich Renta Fija Chile Index Fund, que comprenden los estados de situación financiera al 31 de diciembre de 2019 y 2018 y los correspondientes estados de resultados integrales, de cambios en el patrimonio y de flujos de efectivo por los años terminados en esas fechas y las correspondientes notas a los estados financieros.

### *Responsabilidad de la Administración por los estados financieros*

La Administradora Zurich Chile Asset Management Administradora General de Fondos S.A. es responsable por la preparación y presentación razonable de estos estados financieros de acuerdo con las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF). Esta responsabilidad incluye el diseño, implementación y mantención de un control interno pertinente para la preparación y presentación razonable de estados financieros que estén exentos de representaciones incorrectas significativas, ya sea debido a fraude o error.

### *Responsabilidad del auditor*

Nuestra responsabilidad consiste en expresar una opinión sobre estos estados financieros a base de nuestras auditorías. Efectuamos nuestras auditorías de acuerdo con normas de auditoría generalmente aceptadas en Chile. Tales normas requieren que planifiquemos y realicemos nuestro trabajo con el objeto de lograr un razonable grado de seguridad de que los estados financieros están exentos de representaciones incorrectas significativas.

Una auditoría comprende efectuar procedimientos para obtener evidencia de auditoría sobre los montos y revelaciones en los estados financieros. Los procedimientos seleccionados dependen del juicio del auditor, incluyendo la evaluación de los riesgos de representaciones incorrectas significativas de los estados financieros, ya sea debido a fraude o error. Al efectuar estas evaluaciones de los riesgos, el auditor considera el control interno pertinente para la preparación y presentación razonable de los estados financieros de la entidad con el objeto de diseñar procedimientos de auditoría que sean apropiados en las circunstancias, pero sin el propósito de expresar una opinión sobre la efectividad del control interno de la entidad. En consecuencia, no expresamos tal tipo de opinión. Una auditoría incluye, también, evaluar lo apropiadas que son las políticas de contabilidad utilizadas y la razonabilidad de las estimaciones contables significativas efectuadas por la Administración del Fondo, así como una evaluación de la presentación general de los estados financieros.

Consideramos que la evidencia de auditoría que hemos obtenido es suficiente y apropiada para proporcionarnos una base para nuestra opinión.



Santiago, 25 de marzo de 2020  
Fondo de Inversión Zurich Renta Fija Chile Index Fund  
2

### *Opinión*

En nuestra opinión, los mencionados estados financieros presentan razonablemente, en todos sus aspectos significativos, la situación financiera de Fondo de Inversión Zurich Renta Fija Chile Index Fund al 31 de diciembre de 2019 y 2018, los resultados de sus operaciones y los flujos de efectivo por los años terminados en esas fechas de acuerdo con las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF).

### *Otros asuntos - Estados Complementarios*

Nuestras auditorías fueron efectuadas con el propósito de formarnos una opinión sobre los estados financieros tomados como un todo. La información complementaria adjunta, que comprenden el resumen de la cartera de inversiones, estado de resultado devengado y realizado y el estado de utilidad para la distribución de dividendos, contenidos en el Anexo 1 adjunto, se presenta con el propósito de efectuar un análisis adicional y no es una parte requerida de los estados financieros. Tal información suplementaria es responsabilidad de la Administración y fue derivada de, y se relaciona directamente con, los registros contables y otros registros subyacentes utilizados para preparar los estados financieros. La mencionada información suplementaria ha estado sujeta a los procedimientos de auditoría aplicados en la auditoría de los estados financieros y a ciertos procedimientos adicionales, incluyendo la comparación y conciliación de tal información suplementaria directamente con los registros contables y otros registros subyacentes utilizados para preparar los estados financieros o directamente con los mismos estados financieros y los otros procedimientos adicionales, de acuerdo con normas de auditoría generalmente aceptadas en Chile. En nuestra opinión, la mencionada información suplementaria se presenta razonablemente en todos los aspectos significativos en relación con los estados financieros tomados como un todo.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados de Situación Financiera  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

	Nota	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
<b>Activos</b>			
Activos corrientes:			
Efectivo y efectivo equivalente	8	27.486	2.933
Activos financieros a valor razonable con efecto en resultados	9	9.228.116	6.641.660
Cuentas y documentos por cobrar por operaciones	11	-	-
Otros activos	13	15.993	-
Total Activo		9.271.595	6.644.593
<b>Pasivos y Patrimonio</b>			
Pasivos corrientes:			
Cuentas y documentos por pagar por operaciones	11	3.050	18.221
Remuneraciones sociedad administradora	12	3.989	2.162
Otros pasivos	13	11.332	36.607
Total Pasivos		18.371	56.990
Patrimonio Neto:			
Aportes		1.790.786	6.283.549
Resultados acumulados		6.587.603	(21.581)
Resultado del ejercicio		874.835	325.635
Dividendos provisorios		-	-
Total Patrimonio Neto		9.253.224	6.587.603
<b>Total Pasivos y Patrimonio</b>		<b>9.271.595</b>	<b>6.644.593</b>

Las notas adjuntas son parte integral de estos estados financieros.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados de Resultados Integrales  
 por el período comprendido al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

	Nota	Acumulado 01-01-2019 31-12-2019 M\$	Acumulado 01-01-2018 31-12-2018 M\$
Ingresos (gastos) de la operación:			
Intereses y reajustes	14	340.584	234.154
Diferencias de cambio netas sobre efectivo y efectivo equivalente		1.760	39
Cambios netos en valor razonable de activos financieros y pasivos financieros a valor razonable con efecto en resultados		605.895	126.721
Resultado en venta de instrumentos financieros		(3.356)	761
Total ingresos de la operación		944.883	361.675
Gastos:			
Comisión de administración	12	(47.589)	(21.030)
Otros gastos de operación	15	(22.459)	(15.010)
Total gastos de operación		(70.048)	(36.040)
<b>Resultado del período</b>		<b>874.835</b>	<b>325.635</b>

Las notas adjuntas son parte integral de estos estados financieros.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados de Cambios en el Patrimonio Neto  
por el período comprendido al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

31 de diciembre de 2019						
Detalle	Aportes M\$	Otras reservas M\$	Resultados acumulados M\$	Resultado del ejercicio M\$	Dividendos provisorios M\$	Total M\$
Saldo inicial	6.283.549	-	(21.581)	325.635	-	6.587.603
Cambios contables	-	-	-	-	-	-
<b>Subtotales</b>	<b>6.283.549</b>	<b>-</b>	<b>(21.581)</b>	<b>325.635</b>	<b>-</b>	<b>6.587.603</b>
Aportes	7.876.378	-	-	-	-	7.876.378
Repartos de patrimonio	(6.085.592)	-	-	-	-	(6.085.592)
Repartos de dividendos	-	-	-	-	-	-
Resultados integrales del ejercicio:	-	-	-	-	-	-
Resultado del ejercicio	-	-	-	874.835	-	874.835
Otros resultados integrales	-	-	-	-	-	-
Otros movimientos (*)	(6.283.549)	-	6.609.184	(325.635)	-	-
<b>Totales</b>	<b>1.790.786</b>	<b>-</b>	<b>6.587.603</b>	<b>874.835</b>	<b>-</b>	<b>9.253.224</b>

(\*) Movimientos explicados en Nota 1.

31 de diciembre de 2018						
Detalle	Aportes M\$	Otras reservas M\$	Resultados acumulados M\$	Resultado del ejercicio M\$	Dividendos provisorios M\$	Total M\$
Saldo inicial	4.067.881	-	-	(21.581)	-	4.046.300
Cambios contables	-	-	-	-	-	-
<b>Subtotales</b>	<b>4.067.881</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(21.581)</b>	<b>-</b>	<b>4.046.300</b>
Aportes	3.201.792	-	-	-	-	3.201.792
Repartos de patrimonio	(986.124)	-	-	-	-	(986.124)
Repartos de dividendos	-	-	-	-	-	-
Resultados integrales del ejercicio:	-	-	-	-	-	-
Resultado del ejercicio	-	-	-	325.635	-	325.635
Otros resultados integrales	-	-	-	-	-	-
Otros movimientos	-	-	(21.581)	21.581	-	-
<b>Totales</b>	<b>6.283.549</b>	<b>-</b>	<b>(21.581)</b>	<b>325.635</b>	<b>-</b>	<b>6.587.603</b>

Las notas adjuntas son parte integral de estos estados financieros.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados de Flujos de Efectivo  
por el período comprendido al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

	Nota	Acumulado 01-01-2019 31-12-2019 M\$	Acumulado 01-01-2018 31-12-2018 M\$
Flujos de efectivo originado por actividades de la operación			
Compra de activos financieros	9	(21.894.859)	(8.034.032)
Venta de activos financieros	9	20.235.533	5.804.708
Intereses diferencias de cambio y reajustes recibidos		-	-
Dividendos recibidos		-	-
Dividendos pagados		-	-
Liquidación de instrumentos financieros derivados		-	-
Pago de cuentas y documentos por pagar		(45.797)	(20.436)
Otros ingresos de operación recibidos		-	-
Otros gastos de operación pagados		(37.182)	(1.218)
Flujo neto originado por actividades de la operación		<u>(1.742.305)</u>	<u>(2.250.978)</u>
Flujos de efectivo originado por actividades de financiamiento			
Aportes		7.876.378	3.201.792
Repartos de patrimonio		(6.111.280)	(949.884)
Flujo neto originado por actividades de financiamiento		<u>1.765.098</u>	<u>2.251.908</u>
(Disminución)/aumento neto de efectivo y efectivo equivalente		22.793	930
Saldo inicial de efectivo y efectivo equivalente		<u>2.933</u>	<u>1.964</u>
Diferencias de cambio netas sobre efectivo y efectivo equivalente		1.760	39
<b>Saldo final de efectivo y efectivo equivalente</b>	<b>8</b>	<b><u>27.486</u></b>	<b><u>2.933</u></b>

Las notas adjuntas son parte integral de estos estados financieros.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(1) Información general**

Fondo de Inversión Zurich Renta Fija Chile Index Fund (en adelante el “Fondo”), es un Fondo domiciliado y constituido bajo las leyes chilenas, con domicilio en Av. Apoquindo N°5550, piso 18, Las Condes, ciudad de Santiago, Chile.

El objetivo del Fondo es ofrecer una alternativa de inversión para aquellas personas naturales y jurídicas y otras entidades interesadas en invertir en un horizonte de mediano y largo plazo mediante el manejo de una cartera diversificada, compuesta por instrumentos de deuda de emisores nacionales.

Para lograr lo anterior, el Fondo invertirá, directa o indirectamente, el 100% de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales o instrumentos de capitalización que invierten la mayor parte de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales.

Las cuotas del Fondo cotizan en bolsa, bajo los nemotécnicos CFIEARFCHA, CFIEACICUI, CFIZCHRFCE y no han sido sometidas a clasificación de riesgo.

El Fondo podrá mantener en cartera cuotas de propia emisión, hasta por un monto máximo equivalente a un 5% del patrimonio total del Fondo.

Las actividades de inversión del Fondo son administradas por Zurich Chile Asset Management Administradora General de Fondos S.A. (en adelante la “Administradora”).

Con fecha 29 de junio de 2017, la Comisión para el Mercado Financiero (CMF) procedió a aprobar el reglamento interno del Fondo, el cual se encuentra vigente a la fecha de los presentes estados financieros.

El Fondo tendrá un plazo de duración indefinido.

Los presentes estados financieros fueron autorizados por el Directorio para emisión y publicación, el 25 de marzo de 2020.

**Reclasificaciones significativas a los estados financieros**

Para el período terminado al 31 de diciembre de 2019, la Administradora ha efectuado ciertas reclasificaciones en el Estado de cambio del patrimonio neto del Fondo, presentados en la línea de “Otros movimientos”, las cuales mejoran la presentación de la información financiera. Estas reclasificaciones no tienen impacto en los resultados ni en el Patrimonio del Fondo.

**Modificaciones al Reglamento Interno 2019**

De acuerdo a lo establecido en la Sección III de la Norma de carácter General N° 365, emitida por la Comisión para el Mercado Financiero, las modificaciones efectuadas al Reglamento Interno son las siguientes:

1. Se modifica el nombre del Fondo, a “Fondo de Inversión Zurich Descuento”. Como consecuencia de lo anterior, se modifica el nombre del Fondo en todas aquellas secciones del Reglamento Interno en las que aparece.
2. En la Selección A del Reglamento Interno, “Características del Fondo”, número 1, “Características generales”, se efectúan las siguientes modificaciones:

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

- Modificar el nombre de “Euroamerica Renta Fija Chile Index” a “Zurich Renta Fija Chile Index”
  - Modificar la administradora del Fondo de Zurich Administradora General de Fondos S.A. a la Sociedad.
  - Modificar las referencias a la “Superintendencia de Valores y Seguros” por la “Comisión para el Mercado Financiero”
  - Modificar la letra B “Política de Inversión y Diversificación”, numeral 2 “Política de inversiones”, título “Clasificación de Riesgo”, respecto de los saldos disponibles
3. En la Selección A del Reglamento Interno, “Características del Fondo”, número 1, “Características generales”, se efectúan las siguientes modificaciones (continuación):

pesos chilenos que podrá mantener el Fondo sobre el activo en forma permanente producto de sus propias operaciones (compra y venta) como también debido a las eventuales variaciones de capital de dichas inversiones, del 10% al 20%.

- Modificar la letra B “Política de Inversión y Diversificación”, numeral 3 “Características y diversificación de las Inversiones”, punto 3.2. “Diversificación de las Inversiones”, respecto del límite máximo de inversión sobre el activo del Fondo excepto tratándose de la inversión en cuotas de fondos, del 10% al 20%.
- Modificar la letra B “Política de Inversión y Diversificación”, numeral 3 “Características y diversificación de las inversiones”, punto 3.3., en el mismo sentido señalando en el punto anterior.
- Agregar y/o modificar en la letra F “Series, Remuneraciones, Comisiones y Gastos”:
  - Numeral 1 “Series”:
    - Agregar en la Serie B-APV/APVC como requisito de ingreso que para planes de colectivos o grupales el número de adherentes por empresa de hasta 100 partícipes.
    - Crear series D, para aportes por montos iguales o superiores a MM \$250.
    - Crear serie E, para aportes por montos iguales o superiores a MM \$1.000.
    - Crear serie H-APV/APVC E I-APV/APVC, para aporte destinado a planes de APV/APVC. Para planes colectivos o grupales el número de adherentes por empresa debe ser superior a 100 e inferior o igual a 300 partícipes, respectivamente.
    - Crear serie EXT, donde el aporte debe ser enterado exclusivamente por inversionistas sin domicilio ni residencia en Chile.
    - Modificar el nombre de la serie EA-AM por Z.
    - Crear serie CUI, para aportes enterados por compañías de seguro a nombre de sus clientes partícipes con ocasión de la contratación de planes de seguros que combinan protección y ahorro.
    - Crear serie N, para aportes efectuados en forma directa por el partícipe sin intermediarios y por montos iguales o superiores a \$ MM250.
    - Crear serie P y R, sin mayores requisitos de ingreso, orientada a inversionistas con un horizonte de inversión de mediano y largo plazo, y para aquellos que con el mismo objetivo deseen percibir el 100% de las rentas percibidas por el fondo, respectivamente.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

- Numeral 2 “Remuneración de cargo del Fondo y gastos”:
  - Agregar las remuneraciones de las series D, E, H-APV/APVC, I-APV/APVC, EXT, CUI, N, P y R.
  - Modificar la remuneración de Z, ex EA-AM, de 0,01% a 0,595%
- 4. En la Selección A del Reglamento Interno, “Características del Fondo”, número 1, “Características generales”, se efectúan las siguientes modificaciones (continuación):
  - Numeral 3 “Comisión o remuneración de cargo del Aportante”:
    - Agregar las remuneraciones de cargo del aportante de las series D, E, H-APV/APVC, I-APV/APVC, EXT, CUI, N, P y R.
    - Modificar el nombre de la serie “EA-AM” por “Z”.
  - Numeral 4 “Remuneración aportada al Fondo”
    - Agregar las remuneraciones aportadas al Fondo de las series D, E, H-APV/APVC, I, EXT, CUI, N, P y R.
    - Modificar el nombre de la serie “EA-AM” por “Z”.
  - Agregar en la letra G “Aporte, Rescate y Valorización de Cuotas”, numeral 1 “Aportes y rescate de cuotas”, título “Medios para efectuar aportes y solicitar rescates”, para que el partícipe pueda realizarla mediante el envío de instrucciones mediante carta dirigida al domicilio principal de la Administradora o de sus agentes, o mediante un correo electrónico dirigido al ejecutivo comercial asignado en la Administradora o al ejecutivo asignado o agente.
  - Modificar la página web a [www.webchilena.cl](http://www.webchilena.cl).
  - Modificar la letra I “Otra información relevante”, título “Política de Reparto de Beneficios”, para que cada cuota del Fondo tenga derecho a participar de los dividendos que reparta el Fondo como Beneficios Netos Percibidos, en la misma proporción, con las excepciones y características ahí señalados.
  - Agregar en la letra I “Otra información relevante”, título “Beneficio Tributario”, las series H-APV/APVC e I-APV/APVC para acogerse al artículo 42 bis de la Ley sobre Impuesto a la Renta, relativo al Ahorro Previsional Voluntario.

**Modificaciones al Reglamento Interno 2018**

Con fecha 07 de agosto de 2018, en cumplimiento con la Norma de Carácter General N°365, se depositaron en la Comisión para el Mercado Financiero las siguientes modificaciones al Reglamento Interno:

1. En la Sección B del Reglamento Interno, “*Política de Inversión y Diversificación*”, Número 2, “*Política de inversiones*”, en relación al título “*Mercados de inversión*”, se sustituye la referencia a la Superintendencia de Valores y Seguros por la referencia a la Comisión para el Mercado Financiero. Asimismo, y como consecuencia de la modificación antes señalada, se ha suprimido cualquier referencia a la Superintendencia de Valores y Seguros de manera de hacer referencia en adelante a dicha Comisión.
2. En la Sección F del Reglamento Interno, “*Series, Remuneraciones, Comisiones y Gastos*”:
  - a) En el número 1. “*Series*”, se crea la nueva serie CUI, la cual será exclusiva para aportes enterados por compañías de seguro a nombre de sus clientes partícipes con ocasión de la contratación de planes de seguros que combinan protección y ahorro, el valor cuota inicial será de \$1.000 y la moneda en que se recibirán y pagaran los rescates será en Pesos de Chile. Adicionalmente se establecen las características relevantes de la Serie.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

- b) En el número 2. “*Remuneración de cargo del Fondo y gastos*”, numeral 2.1. “*Remuneración de cargo del Fondo*”, se incorpora la remuneración fija de la Serie CUI, la cual será de hasta un 1,00% anual IVA incluido.
  - c) En el número 3, “*Comisión o remuneración de cargo del partícipe*”, se incluye a la Serie CUI, señalando al efecto que no contempla remuneración de cargo del partícipe.
  - d) En el número 4, “*Remuneración aportada al Fondo*”, se incluye a la Serie CUI, señalando al efecto que no se contempla.
3. En la Sección H del Reglamento Interno, “*Otra información relevante*”, se incorpora una cláusula transitoria permitiendo el canje de cuotas de la Serie A por cuotas de la nueva Serie CUI.

Adicionalmente a los cambios señalados precedentemente, se efectuaron correcciones de ortografía y gramática, los cuales no alteran el contenido del Reglamento Interno.

Se hace presente que, a partir de la fecha del depósito y hasta la fecha de entrada en vigencia de las modificaciones, los partícipes del Fondo tendrán derecho a rescatar las cuotas que hubieren suscrito antes de que rijan estas modificaciones, sin que les sea aplicable deducción alguna por concepto de remuneración de cargo del partícipe.

**(2) Resumen de criterios contables significativos**

**(a) Bases de preparación**

Los presentes estados financieros de Fondo de Inversión Zurich Renta Fija Chile Index Fund, han sido preparados de acuerdo con Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF), emitidos por International Accounting Standard Board (en adelante “IASB”) y por la Comisión para el Mercado Financiero (CMF).

1. Normas, interpretaciones y enmiendas obligatorias por primera vez para los ejercicios financieros iniciados el 1 de enero de 2019.

Normas e interpretaciones

NIIF 16 “Arrendamientos” – Publicada en enero de 2016 establece el principio para el reconocimiento, medición, presentación y revelación de arrendamientos. NIIF 16 sustituye a la NIC 17 actual e introduce un único modelo de contabilidad para el arrendatario y requiere que un arrendatario reconozca los activos y pasivos de todos los contratos de arrendamiento con un plazo de más de 12 meses, a menos que el activo subyacente sea de bajo valor. NIIF 16 es efectiva para períodos anuales que comienzan en o después del 1 de enero 2019 y su aplicación anticipada está permitida para las entidades que aplican la NIIF 15 antes de la fecha de la aplicación inicial de la NIIF 16.

CINIIF 23 “Posiciones tributarias inciertas”. Publicada en junio de 2017. Esta interpretación aclara cómo se aplican los requisitos de reconocimiento y medición de la NIC 12 cuando hay incertidumbre sobre los tratamientos fiscales.

Enmiendas y mejoras

Enmienda a NIIF 9 “Instrumentos Financieros”. Publicada en octubre de 2017. La modificación permite que más activos se midan al costo amortizado que en la versión anterior de la NIIF 9,

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

en particular algunos activos financieros prepagados con una compensación negativa. Los activos calificados, que incluyen son algunos préstamos y valores de deuda, los que de otro modo se habrían medido a valor razonable con cambios en resultados (FVTPL). Para que califiquen al costo amortizado, la compensación negativa debe ser una "compensación razonable por la terminación anticipada del contrato".

Enmienda a NIC 23 "Costos por Préstamos" Publicada en diciembre de 2017. La enmienda aclaró que, si un préstamo específico permanece pendiente después de que el activo calificado esté listo para su uso previsto o venta, se convierte en parte de los préstamos generales.

Enmienda a NIC 19 "Beneficios a los empleados" Publicado en febrero de 2018. La enmienda requiere que las entidades, utilicen suposiciones actualizadas para determinar el costo del servicio actual y el interés neto por el resto del período después de una modificación, reducción o liquidación del plan; y reconocer en ganancias o pérdidas como parte del costo del servicio pasado, o una ganancia o pérdida en la liquidación, cualquier reducción en un excedente, incluso si ese excedente no fue previamente reconocido debido a que no superaba el límite superior del activo.

La adopción de las normas, enmiendas e interpretaciones antes descritas, no tienen un impacto significativo en los estados financieros del Fondo.

2. Normas, interpretaciones y enmiendas emitidas, cuya aplicación aún no es obligatoria, para las cuales no se ha efectuado adopción anticipada.

Normas e interpretaciones	Obligatoria para ejercicios iniciados a partir de
Enmiendas a la NIC 1 "Presentación de estados financieros" y NIC 8 "Políticas contables, cambios en las estimaciones y errores contables" Publicada en octubre de 2018. Usa una definición consistente de materialidad en todas las NIIF y el Marco Conceptual para la Información Financiera; aclara la explicación de la definición de material; e incorporar algunas de las guías en la NIC 1 sobre información inmaterial.	01-01-2020
Enmienda a la NIIF 3 "Definición de un negocio" Publicada en octubre de 2018. Revisa la definición de un negocio. De acuerdo a la retroalimentación recibida por el IASB, la aplicación de la actual guía se piensa frecuentemente que es demasiado compleja, y resulta en demasiadas transacciones que califican como combinaciones de negocios.	01-01-2020

La Administradora del fondo estima que la adopción de las normas, interpretaciones y enmiendas antes descritas, no tendrá un impacto significativo en los estados financieros del fondo en el período de su primera aplicación.

3. Período cubierto

Los estados de situación financiera fueron preparados al 31 de diciembre de 2019 y 2018, los estados de resultados integrales, de cambios en el patrimonio neto y flujos de efectivo por los períodos terminados al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

4. Juicios y estimaciones

La preparación de estados financieros en conformidad con NIIF requiere el uso de ciertas estimaciones contables críticas. También necesita que la administración utilice su criterio en el proceso de aplicar los principios contables del Fondo. Estas áreas que implican un mayor nivel de discernimiento o complejidad, o áreas donde los supuestos y estimaciones son significativos para los estados financieros, corresponden principalmente a activos financieros a valor razonable con efecto en resultados.

**(b) Conversión de moneda**

(i) Moneda funcional y presentación

Los inversionistas del Fondo proceden en su totalidad del mercado local, siendo los aportes de cuotas denominados en pesos chilenos. La principal actividad del Fondo es invertir en instrumentos de deuda de emisores nacionales, y ofrecer a los inversionistas del mercado local una alta rentabilidad comparada con otros productos disponibles en el mercado. El rendimiento del Fondo es medido e informado a los inversionistas en pesos chilenos. La administración considera el peso chileno como la moneda que representa más fielmente los efectos económicos de las transacciones, hechos y condiciones subyacentes.

(ii) Transacciones y saldos en unidades de reajuste

Las transacciones en pesos chilenos y unidades de fomento, son convertidas a la moneda funcional utilizando los tipos de cambio vigentes en las fechas de las transacciones. Los activos y pasivos financieros en unidad de reajuste y en pesos chilenos son convertidos a la moneda funcional utilizando el tipo de cambio vigente a la fecha de los estados de situación financiera.

Las diferencias que surgen de la conversión de dichos activos y pasivos financieros son incluidas en el estado de resultados integrales. Las diferencias de cambio relacionadas con el Efectivo y equivalentes al efectivo se presentan en el estado de resultados integrales dentro de "Diferencias de cambio netas sobre Efectivo y equivalentes al efectivo". Las diferencias de cambio relacionadas con los activos y pasivos financieros contabilizados a valor razonable con efecto en resultados son presentadas en el estado de resultados dentro de "Cambios netos en valor razonable de activos financieros y pasivos financieros a valor razonable con efecto en resultados".

**(c) Activos y pasivos financieros**

(i) Reconocimiento y medición inicial

Inicialmente, el Fondo reconoce un activo o pasivo financiero a valor razonable más, en el caso de una partida no valorizada posteriormente al valor razonable con cambio en resultados, los costos de transacción que son atribuibles directamente a su adquisición o emisión.

(ii) Clasificación

Inicialmente, un activo financiero es clasificado como medido a costo amortizado o valor razonable.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

Un activo financiero deberá medirse al costo amortizado si se cumplen las 2 condiciones siguientes:

- El activo se mantiene dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los activos para obtener los flujos de efectivo contractuales; y
- Las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que son únicamente pagos del capital e intereses sobre el importe del capital pendiente.

Si un activo financiero no cumple estas 2 condiciones, es medido a valor razonable.

El Fondo evalúa un modelo de negocio a nivel de la cartera, ya que refleja mejor el modo en el que es gestionado el negocio y en que se provee información a la administración.

Al evaluar si un activo se mantiene dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los activos para recolectar los flujos de efectivo contractuales, el Fondo considera:

- Las políticas y los objetivos de la administración para la cartera y la operación de dichas políticas en la práctica;
- Cómo evalúa la administración el rendimiento de la cartera;
- Si la estrategia de la administración se centra en recibir ingresos por intereses contractuales;
- El grado de frecuencia de ventas de activos esperadas;
- Las razones para las ventas de activos; y
- Si los activos que se venden se mantienen por un período prolongado en relación a su vencimiento contractual o se venden prontamente después de la adquisición o un tiempo prolongado antes del vencimiento.

Los activos financieros mantenidos para negociación no son mantenidos dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener el activo para recolectar los flujos de efectivo contractuales.

El Fondo ha designado contabilizar la totalidad de sus activos financieros al valor razonable con cambios en resultados, debido a que la designación elimina o reduce significativamente una asimetría contable que podría surgir.

(iii) Baja

El Fondo da de baja en su estado de situación financiera un activo financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del activo financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivos contractuales por el activo financiero durante una transacción en que se transfieren todos los riesgos y beneficios de propiedad del activo financiero. Toda participación en activos financieros transferidos que es creada o retenida por la Sociedad es reconocida como un activo o un pasivo separado. Cuando se da de baja en cuentas un activo financiero, la diferencia entre el valor en libros del activo (o el valor en libros asignado a la porción del activo transferido), y la suma de (i) la contraprestación recibida (incluyendo cualquier activo nuevo obtenido menos cualquier pasivo nuevo asumido) y (ii)

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

cualquier ganancia o pérdida acumulativa que haya sido reconocida en el otro resultado integral, se reconoce en la utilidad del ejercicio.

(iv) Determinación de valor razonable

El valor razonable de un activo a pasivo financiero es el monto por el cual puede ser intercambiado un activo o cancelado un pasivo, entre un comprador y un vendedor interesados y debidamente informados, en condiciones de independencia mutua.

El Fondo estima el valor razonable de sus instrumentos usando precios cotizados en el mercado activo para ese instrumento. Un mercado es denominado activo si los precios cotizados se encuentran fácil y regularmente disponibles y representan transacciones reales y que ocurren regularmente sobre una base independiente.

Si el mercado de un instrumento financiero no fuera activo, se determinará el valor razonable utilizando una técnica de valorización. Entre las técnicas de valorización se incluye el uso de transacciones de mercado recientes entre partes interesadas y debidamente informadas que actúen en condiciones de independencia mutua, si estuvieran disponibles, así como las referencias al valor razonable de otro instrumento financiero sustancialmente igual, el descuento de los flujos de efectivo y los modelos de fijación de precio de opciones. El Fondo incorporará todos los factores que considerarían los participantes en el mercado para establecer el precio y será coherente con las metodologías económicas generalmente aceptadas para calcular el precio de los instrumentos financieros.

(v) Identificación y medición del deterioro

El Fondo evalúa permanentemente si existe evidencia objetiva que los activos financieros no reconocidos al valor razonable con cambio en resultado están deteriorados, exceptuando los créditos y cuentas por cobrar a clientes. Estos activos financieros están deteriorados si existe evidencia objetiva que demuestre que un evento que causa la pérdida haya ocurrido después del reconocimiento inicial del activo y ese evento tiene un impacto sobre los flujos de efectivo futuros estimados del activo financiero que pueda ser estimado con fiabilidad.

**(d) Operaciones por operaciones de leasing**

El Fondo no mantiene operaciones de esta naturaleza.

**(e) Inversiones valorizadas por el método de la participación**

El Fondo no mantiene operaciones de esta naturaleza.

**(f) Propiedades de inversión**

El Fondo no mantiene operaciones de esta naturaleza.

**(g) Presentación neta o compensada de instrumentos financieros**

Los activos y pasivos financieros son compensados y el monto neto es así informado en el estado de situación financiera cuando existe un derecho legal para compensar los importes reconocidos y existe la intención de liquidar sobre una base neta, o realizar el activo y liquidar el pasivo simultáneamente, situación que se da principalmente en los instrumentos derivados.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(h) Cuentas por cobrar y pagar a intermediarios**

Los montos por cobrar y pagar a intermediarios representan deudores por valores vendidos y acreedores por valores comprados que han sido contratados, pero aún no saldados o entregados en la fecha de los estados de situación financiera, respectivamente.

Estos montos se reconocen inicialmente a valor razonable y posteriormente se miden al costo amortizado empleando el método de interés efectivo, menos la provisión por deterioro de valor para montos correspondientes a cuentas por cobrar a intermediarios.

**(i) Deterioro de valor de activos financieros a costo amortizado**

El Fondo no mantiene activos financieros valorizados a costo amortizado.

**(j) Efectivo y efectivo equivalente**

El efectivo y efectivo equivalente, incluye el efectivo en caja y los saldos en cuentas corrientes bancarias, depósitos a la vista y otras inversiones de corto plazo de alta liquidez utilizadas para administrar su caja con vencimientos originales iguales o inferiores a 90 días desde la fecha de adquisición, de gran liquidez, fácilmente convertibles en importes determinados de efectivo y sin riesgo de pérdida de valor y sobregiros bancarios.

**(k) Aportes (capital pagado)**

Las cuotas emitidas se clasifican como patrimonio. El valor cuota de Fondo se obtiene dividiendo el valor del patrimonio por el número de cuotas pagadas.

El aporte recibido se expresará en cuotas del Fondo utilizando el valor cuota correspondiente al mismo día de la recepción de la solicitud de aporte, si éste se efectuare antes del cierre de operaciones del Fondo o al valor cuota del día siguiente al de la recepción, si el aporte se efectuare con posterioridad a dicho cierre. El valor cuota será calculado en la forma señalada en el inciso primero del artículo 10 del Reglamento de la Ley N° 20.712.

**(l) Ingresos financieros**

Los ingresos financieros se reconocen a prorrata del tiempo transcurrido, utilizando el método de interés efectivo e incluye ingresos financieros procedentes de efectivo y efectivo equivalente, títulos de deuda y otras actividades que generen ingresos financieros para el Fondo.

**(m) Dividendos por pagar**

El Fondo establece en la Letra I de su Reglamento Interno, que distribuirá por concepto de dividendos anualmente a lo menos el 30% de los beneficios netos percibidos durante el ejercicio, y que no podrá distribuir dividendos provisorios entre los aportantes, con cargo a los resultados del ejercicio.

**(n) Tributación**

El Fondo está domiciliado en Chile. Bajo las leyes vigentes en Chile, no existe ningún impuesto sobre ingresos, utilidades, ganancias de capital u otros impuestos pagaderos por el Fondo.

El Fondo se encuentra exento del pago de impuesto a la renta, en virtud de haberse constituido al amparo de la Ley N°20.712, Título VII. En consideración a lo anterior, no se ha registrado efecto en los Estados Financieros por concepto de impuesto a la renta e impuestos diferidos.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(3) Cambios contables**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el Fondo no ha efectuado cambios contables.

**(4) Inversiones valorizadas por el método de la participación**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el Fondo no mantiene inversiones que se encuentren valorizadas por el método de la participación.

**(5) Propiedades de Inversión**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el Fondo no presenta Operaciones de esta Naturaleza.

**(6) Política de inversión del Fondo**

La política de inversión vigente se encuentra definida en la letra B del título “Política de inversión y diversificación” del Reglamento Interno del Fondo, aprobado por la Comisión para el Mercado Financiero (CMF) con fecha 28 de junio de 2017, el que se encuentra disponible en nuestras oficinas ubicadas en Avenida Apoquindo N°3885, piso 20, Las Condes, ciudad de Santiago.

El objetivo del Fondo es ofrecer una alternativa de inversión para aquellas personas naturales y jurídicas y otras entidades interesadas en invertir en un horizonte de mediano y largo plazo mediante el manejo de una cartera diversificada, compuesta por instrumentos de deuda de emisores nacionales.

Para lograr lo anterior, el Fondo invertirá, directa o indirectamente, el 100% de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales o instrumentos de capitalización que invierten la mayor parte de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales.

**(a) El Fondo podrá invertir sus recursos en los siguientes valores y bienes, respecto del activo total del Fondo**

<b>a.1 Instrumentos de deuda emitidos por emisores nacionales</b>	<b>% máximo del activo total</b>
1. Instrumentos de deuda emitidos o garantizados por el Estado o el Banco Central de Chile.	100
2. Instrumentos de deuda emitidos o garantizados por bancos e instituciones financieras nacionales.	100
3. Instrumentos de deuda inscritos en el Registro de Valores, emitidos por CORFO y sus filiales, empresas fiscales, semifiscales de administración autónoma y descentralizadas.	100
4. Instrumentos de deuda inscritos en el Registro de Valores, emitidos por sociedades anónimas u otras entidades registradas en el mismo registro.	100
5. Títulos de deuda de securitización, que cumplan los requisitos establecidos por la Comisión para el Mercado Financiero (CMF).	100

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

<b>a.2 Instrumentos de capitalización emitidos por emisores nacionales</b>	<b>% máximo del activo total</b>
1. Cuotas de Fondos mutuos de aquellos regulados por la Ley N° 20.712 de 2014 que inviertan la mayor parte de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales.	100
2. Cuotas de Fondos de inversión rescatables de aquellos regulados por la Ley N° 20.712 de 2014 que inviertan la mayor parte de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales.	100

**(b) Diversificación de las inversiones**

1. Límite máximo de inversión por emisor: 20% del activo del Fondo excepto tratándose de la inversión en cuotas de Fondos, en cuyo caso aplicará el límite indicado en el Número 5 siguiente.
2. Límite máximo de inversión en títulos de deuda de securitización correspondientes a un patrimonio de los referidos en el Título XVIII de la Ley N° 18.045 de Mercado de Valores: 10% del activo del Fondo.
3. Límite máximo de inversión por grupo empresarial y sus personas relacionadas: 25% del activo del Fondo.
4. Límite máximo de Inversión en instrumentos emitidos o garantizados por personas relacionadas a la Administradora.: No aplica.
5. Límite máximo de inversión en cuotas de un Fondo nacional: 10% del activo del Fondo. Con todo, el límite máximo de inversión en cuotas de Fondos administrados por la Administradora o por personas relacionadas será de un 10% del activo del Fondo.
6. Límite máximo de inversión en monedas que podrán ser mantenidas por el Fondo y denominación de los instrumentos en que se efectúen las inversiones:

Moneda/Denominación	%Máx. de Inv. sobre el activo del fondo
Peso chileno	100%
Unidad de fomento	100%

**(7) Administración de riesgos**

La política de inversiones del Fondo establece en términos generales el marco dentro del cual se definen las estrategias de inversión y apunta a acotar los riesgos en los cuales se puede incurrir. Dentro de este marco el Fondo circunscribe su accionar identificando como sus principales Riesgos.

- Riesgo de financiero (riesgo de mercado, riesgo cambiario y riesgo de tasa de interés)
- Riesgo crediticio
- Riesgo de liquidez

Para los riesgos mencionados anteriormente, se cuenta con políticas que contemplan los factores de riesgo representativos de cada riesgo, junto con su monitoreo por parte del área de control de Inversiones, donde se monitorea la exposición del Fondo de acuerdo a lo descrito por las políticas vigentes de control. Lo anterior, también implica el seguimiento continuo de la política de límites tanto normativos como del Reglamento Interno del Fondo.

En línea con los objetivos principales del Fondo, las políticas de gestión de riesgo están orientadas al cumplimiento del objetivo de la política de inversión consistente en invertir el 100% de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales o instrumentos de capitalización que invierten la mayor parte de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

Este Fondo tiene como objetivo es ofrecer una alternativa de inversión para aquellas personas naturales y jurídicas y otras entidades interesadas en invertir en un horizonte de mediano y largo plazo mediante el manejo de una cartera diversificada, compuesta por instrumentos de deuda de emisores nacionales. Para lograr lo anterior, el Fondo invertirá, directa o indirectamente, el 100% de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales o instrumentos de capitalización que invierten la mayor parte de su activo en instrumentos de deuda de emisores nacionales.

Este tipo de Inversionista se caracteriza por tener un perfil de tolerancia al riesgo moderada con un horizonte de inversión de mediano y largo plazo en instrumentos de deuda.

La política de inversiones del Fondo no contempla ninguna limitación o restricción a la inversión en los valores emitidos o garantizados por sociedades que no cuenten con el mecanismo de gobiernos corporativos, descritos en el artículo 50° bis de la Ley No. 18.046. (Reglamento Interno)

El Fondo no podrá invertir más del 50% de su activo en valores que no cumplan con los requisitos de liquidez y profundidad que requiera la Comisión para el Mercado Financiero, establecidos en la Norma de Carácter General N°376. (Reglamento Interno)

Con el objetivo de tener una adecuada gestión de riesgos, así como dar cumplimiento a los requerimientos definidos por la Circular N°1.869 emitida por la Comisión para el Mercado Financiero, la Sociedad implementó un modelo de riesgo que considera la elaboración, aprobación y puesta en práctica de políticas y procedimientos de gestión de riesgos y control interno que contemplan los riesgos asociados en todas las actividades de la Administradora y sus Fondos, las que están incluidas en el Manual de Control Interno de la Administradora, además existen instancias formales tales como comités mensuales de control interno y el reporte de informes trimestrales y semestrales solicitados por la circular 1.869 los cuales son expuestos al Directorio de la Administradora trimestralmente. en el proceso de compensación y liquidación.

**a) Definiciones de los tipos de riesgos**

- Riesgo de mercado: Potencial pérdida causada por cambios en los precios del mercado, que podría generar efectos adversos en la situación financiera de los fondos que maneja la administradora. Abarca el riesgo de tasas de interés, el riesgo cambiario y los riesgos de precios en relación con los activos financieros de un fondo.
- Riesgo crediticio: Potencial exposición a pérdidas económicas debido al incumplimiento por parte de un tercero de los términos y las condiciones que estipula un contrato o un convenio. Este riesgo se divide en las siguientes subcategorías:
- Riesgo crediticio del emisor: Exposición a potenciales quiebras o deterioro de solvencia en los instrumentos de un emisor, que estén dentro de un fondo.
- Riesgo crediticio de la contraparte: Exposición a potenciales pérdidas como resultado de un incumplimiento de contrato o del incumplimiento de una contraparte a su parte de una transacción
- Riesgo de liquidez: Exposición de la administradora o de un fondo manejado por una administradora a una potencial pérdida como resultado de la necesidad de extraer fondos de manera inmediata. Este riesgo se divide en las siguientes subcategorías.
- Riesgo de liquidez de financiamiento: Exposición a una pérdida potencial como resultado de la incapacidad de obtener recursos, conseguir o refundir préstamos a una tasa conveniente o cumplir con las exigencias de los flujos de caja proyectados.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

- Riesgo de liquidez de mercado: Exposición a una pérdida potencial debido a la incapacidad de liquidar un valor en cartera sin afectar de manera adversa el precio del activo, dada la escasa profundidad del mercado de ese activo.
- Riesgo operacional: Exposición a potenciales pérdidas debido a la falta de procedimientos adecuados para la ejecución de las actividades del negocio de una administradora, incluidas las actividades de apoyo correspondientes. Este riesgo se divide en las siguientes subcategorías:
- Riesgo operacional externo (front-office): Exposición a pérdidas potenciales debido a las diversas actividades efectuadas por personas que participan en el negocio de la administradora, por ejemplo, operadores de mesa, administradores de cartera, corredores que asesoran a clientes sobre sus inversiones o se relacionan con éstos, supervisores y ejecutivos de venta.
- Riesgo operacional interno (back-office): Exposición a pérdidas potenciales que podrían ocurrir debido a errores de procesamiento de las transacciones o en la imputación de la información al sistema contable de la administradora para el registro y seguimiento de las actividades del negocio.
- Riesgo de custodia: Exposición a pérdidas potenciales debido a negligencia, malversación de fondos, robo, pérdida o errores en el registro de transacciones efectuadas con valores de terceros mantenidos en una cuenta de la administradora.

**b) Riesgos de mercado**

El riesgo que asumen los inversionistas está en directa relación con los activos en que invierta el Fondo, el cual está dado principalmente por las siguientes variables:

- a) Variación en el precio de los instrumentos de deuda que componen el portfolio;
- b) Variación de los mercados de deuda, producto de las tasas de interés relevantes; y,
- c) El riesgo de crédito de los emisores de instrumentos elegibles.

El nivel de riesgo esperado de las inversiones es moderado

El Fondo administra su exposición al riesgo de precios diversificando entre Instrumentos de deuda nacional, Instrumentos de deuda extranjera y otros instrumentos financieros, con la limitación de que no podrá invertir más del 50% de su activo en valores que no cumplan con los requisitos de liquidez y profundidad que requiera la Comisión para el Mercado Financiero, establecidos en la Norma de Carácter General N°376.

La cartera de Inversión del Fondo se encuentra diversificada por distintas monedas estando principalmente concentrada en U.F.

La siguiente ilustración refleja la diversificación del Fondo por moneda es la siguiente:

<b>Moneda</b>	<b>Diversificación (%)</b>
UF	72,41
Peso chileno	27,59

La cartera de Inversión del Fondo se encuentra diversificada por tipo de instrumentos estando principalmente concentrada en bonos banco y bonos emitidos por la Tesorería General de la República.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

La diversificación por instrumentos es la siguiente:

<b>Sector</b>	<b>2019 %</b>
Bonos Banco	25,26
Bonos Tesorería Gral. de la República reajustables UF	24,99
Bonos Tesorería Gral. de la República \$\$	22,02
Bonos Empresa	18,65
Bonos Banco Central de Chile reajustables en UF	3,02

**c) Riesgo de Liquidez**

El riesgo de liquidez es el riesgo asociado a la posibilidad de que el Fondo no sea capaz de generar suficientes recursos de efectivo para liquidar sus obligaciones en su totalidad cuando llega su vencimiento o ante solicitudes de rescate.

La Administradora provee los parámetros de liquidez para cada fondo. Este control minimizar el riesgo de no tener los apropiados niveles de liquidez ante escenarios de rescates de los partícipes de cada Fondo. Con el fin de minimizar los riesgos en liquidez Zurich Chile Asset Management Administradora General de Fondos S.A. ha definido los siguientes procedimientos de acuerdo a las disposiciones legales, normativas y de los reglamentos internos de los Fondos:

1) Política de liquidez: El Fondo deberá tener al menos un 1% de sus activos invertidos en activos de alta liquidez. Para estos efectos, además de las cantidades disponibles que se mantengan en caja y bancos, se entenderán como instrumentos de alta liquidez los siguientes:

- a) Instrumentos de deuda nacionales que tengan vencimientos inferiores a un año, que califiquen en cualquiera de las siguientes alternativas:
  - i. Que sean emitidos por bancos u otras instituciones financieras nacionales o extranjeras supervisadas bajo la regulación bancaria del país respectivo, por el Estado de Chile o el Gobierno Central, Tesoro Público, Tesorería General, Ministerios, Banco Central o agencias gubernamentales de estados o jurisdicciones que cumplan las condiciones señaladas en la letra a) de la Sección I de la Norma de Carácter General N° 376 de la Comisión para el Mercado Financiero, o aquella que la modifique o reemplace; o
  - ii. Otros títulos de deuda nacionales o extranjeros que no cumplan las condiciones señaladas en el literal i) anterior, y que hayan registrado en los últimos 90 días hábiles, contados desde el día anterior al momento de su determinación, transacciones diarias promedio de al menos US\$50.000 en el mercado secundario.

Cuotas de fondos de inversión nacionales que tengan presencia bursátil según lo dispuesto en la Norma de Carácter General N° 327 de 2012, de la Comisión para el Mercado Financiero, o la que la modifique o reemplace

El Fondo mantendrá el indicado nivel de liquidez con el propósito de contar con los recursos necesarios para cumplir con sus obligaciones en relación a las operaciones que realice, el pago de rescates de cuotas y el pago de beneficios.

2) Exposición máxima por Fondo: Para evitar que la salida de un cliente fuerce la venta en condiciones adversas para el resto de los partícipes, se ha establecido en un 35% el límite máximo sobre el patrimonio total Fondo que pueda poseer un inversionista, sólo o en conjunto con otros inversionistas relacionados. En caso que, producto de las condiciones de mercado o de aportes y

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

rescates, algún partícipe quede con una participación superior a este límite, se le prohibirá ingresar nuevos recursos a este Fondo específico hasta no adecuar su participación dentro de los márgenes.

- 3) Plazo de pago de los rescates: Los Aportantes del Fondo podrán solicitar diariamente a la Administradora el rescate de las cuotas del Fondo de que sean titular. No obstante, lo anterior, los rescates se entenderán cursados el día martes de cada semana o el día hábil bancario inmediatamente siguiente si aquel fuere inhábil. Conforme lo anterior, el rescate de cuotas será pagado en un plazo no mayor a cinco días hábiles bancarios, contados desde la fecha en que la Administradora curse la respectiva solicitud de rescate.
- 4) Rescates por montos significativos: Tratándose de rescates efectuados en un día por un Aportante que alcancen montos que representen un porcentaje igual o superior a un 30% del valor del patrimonio del Fondo, se pagarán dentro de los 31 y hasta los 60 días corridos siguientes a la fecha con que se soliciten dichos rescates, o desde la fecha en que se dé curso al rescate, si se trata de un rescate programado. Para estos efectos, se considerará el valor del patrimonio del Fondo correspondiente al día anterior a la fecha de solicitud de rescate o a la fecha en que se curse el rescate, si se trata de un rescate programado. Lo anterior, será también aplicable, cuando la suma de todos los rescates efectuados por un Aportante en un mismo día, sea igual o superior al monto precedentemente señalado. El Fondo no contempla una estructura de comisiones para rescates por montos significativos diarios.

A continuación, en el siguiente cuadro se analizan los pasivos financieros liquidables incluyendo los activos netos atribuibles a los partícipes dentro de agrupaciones de vencimiento contractual. Los montos en el cuadro son los flujos de efectivo contractuales no descontados excluidos los derivados liquidados brutos.

<b>Al 31 de diciembre de 2019</b>	<b>11 días a 1 mes M\$</b>	<b>1 a 12 meses M\$</b>	<b>Más de 12 meses M\$</b>	<b>Sin vencimiento estipulado M\$</b>
Pasivos financieros a valor razonable con efecto en resultado	-	-	-	-
Cuentas por pagar a intermediarios	-	-	-	-
Rescates por pagar	10.552	-	-	-
Remuneraciones sociedad administradora	3.989	-	-	-
Otros documentos y cuentas por pagar	3.050	-	-	-
Otros pasivos	780	-	-	-
<b>Total Pasivo</b>	<b>18.371</b>	-	-	-
<b>Total Patrimonio Neto</b>	<b>9.253.224</b>	-	-	-

<b>Al 31 de diciembre de 2018</b>	<b>11 días a 1 mes M\$</b>	<b>1 a 12 meses M\$</b>	<b>Más de 12 meses M\$</b>	<b>Sin vencimiento estipulado M\$</b>
Pasivos financieros a valor razonable con efecto en resultado	-	-	-	-
Cuentas por pagar a intermediarios	-	-	-	-
Rescates por pagar	-	-	-	-
Remuneraciones sociedad administradora	2.162	-	-	-
Otros documentos y cuentas por pagar	18.221	-	-	-
Otros pasivos	36.607	-	-	-
<b>Total Pasivo</b>	<b>56.990</b>	-	-	-
<b>Total Patrimonio Neto</b>	<b>6.587.603</b>	-	-	-

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

Las cuotas en circulación son rescatadas previa solicitud del partícipe. Sin embargo, la sociedad no considera que el vencimiento contractual divulgado en el cuadro anterior será representativo de la salida de efectivo real, ya que los partícipes de estos instrumentos normalmente los retienen en el mediano a largo plazo.

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, ningún aportante mantuvo más del 35% de las cuotas en circulación del Fondo.

El Fondo administra su riesgo de liquidez invirtiendo predominantemente en valores que espera poder liquidar dentro de un plazo corto de tiempo, debido a las características de liquidez de los instrumentos.

El siguiente cuadro ilustra el perfil de vencimiento de los activos financieros mantenidos al cierre de cada ejercicio:

<b>Composición cartera de inversión al 31 de diciembre de 2019</b>	<b>Menos de 10 días</b>	<b>10 días a 1 mes</b>	<b>1 a 12 meses</b>	<b>Más de 12 meses</b>	<b>Sin vencimiento</b>	<b>Total</b>
Instrumentos de capitalización	-	-	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-	-	-
Depósitos a plazo bancos nacionales	-	-	49.877	-	-	49.877
Efectos de comercio	-	-	-	-	-	-
Letras hipotecarias	-	-	-	-	-	-
Instrumentos con garantía estatal	54.477	-	116.819	4.684.111	-	4.855.407
Bonos subordinados	-	-	-	-	-	-
Bonos bancos y empresas	-	-	295.884	4.026.948	-	4.322.832
<b>Totales</b>	<b>54.477</b>	<b>-</b>	<b>462.580</b>	<b>8.711.059</b>	<b>-</b>	<b>9.228.116</b>

Este Fondo no presenta inversiones no liquidas. Durante el ejercicio 2019 y 2018, no se presentaron problemas para el pago de rescates.

<b>Composición cartera de inversión al 31 de diciembre de 2019</b>	<b>Menos de 10 días</b>	<b>10 días a 1 mes</b>	<b>1 a 12 meses</b>	<b>Más de 12 meses</b>	<b>Sin vencimiento</b>	<b>Total</b>
Instrumentos de capitalización	-	-	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-	-	-
Depósitos a plazo bancos nacionales	-	-	-	2.879.717	-	2.879.717
Efectos de comercio	-	-	-	-	-	-
Letras hipotecarias	-	-	-	-	-	-
Instrumentos con garantía estatal	-	-	-	3.761.943	-	3.761.943
Bonos subordinados	-	-	-	-	-	-
Bonos bancos y empresas	-	-	-	-	-	-
<b>Totales</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6.641.660</b>	<b>-</b>	<b>6.641.660</b>

**d) Gestión de Riesgo de Capital**

El objetivo del Fondo cuando administra capital es salvaguardar la capacidad del mismo para continuar como una entidad en marcha con el objeto de proporcionar rentabilidad para los partícipes.

Con el objeto de mantener la estructura de capital, la política del Fondo es realizar lo siguiente:

Observar el nivel diario de aportes y rescates en comparación con los activos líquidos y ajustar la cartera del Fondo para tener la capacidad de pagar a los partícipes. Recibir aportes y rescates

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

de nuevas cuotas de acuerdo con el Reglamento Interno del Fondo, lo cual incluye la capacidad para diferir el pago de los rescates y requerir permanencias.

A la fecha de los presentes estados financieros, el Fondo cuenta con un patrimonio de M\$ 9.253.224 y una cartera de activos de M\$ 9.228.116.

Respecto del marco regulatorio y a la política de inversión esta su Reglamento Interno, este Fondo no realiza trading de instrumentos, por lo que el nivel de exposición al riesgo financiero asociado a su operatoria y/o eventual conflicto de interés, se encuentra adecuadamente mitigado.

**e) Riesgo de Crédito**

El concepto de riesgo de crédito se emplea para referirse a aquella incertidumbre financiera, a distintos horizontes de tiempo, relacionada con el cumplimiento de obligaciones suscritas con contrapartes, al momento de ejercer derechos contractuales para recibir efectivo u otros activos financieros por parte del Fondo.

Como política de inversión, el Fondo diversifica el riesgo de crédito seleccionando emisores de acuerdo a su clasificación de riesgo, las que son otorgadas por las clasificadoras consideradas confiables por entidades regulatorias y la comunidad inversionista en el mercado chileno. De acuerdo a esta clasificación, el riesgo es diversificado manteniendo inversiones en distintos emisores, sectores y plazos, cuyos límites de inversión por concepto de riesgo de crédito están definidos en su Reglamento Interno.

Con el fin de controlar dicho riesgo la Comisión para el Mercado Financiero ha dispuesto una serie de controles con límites normativos aplicados a cada fondo, a lo que se agregan controles propios los que están enfocados a reducir riesgo de contraparte y riesgo crediticio del emisor.

**f) Controles a límites normativos:**

Periódicamente se controla el Fondo de acuerdo a las normas establecidas por la Comisión para el Mercado Financiero. En este contexto, se consigna que al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el Fondo no presenta ningún exceso normativo de acuerdo a los controles establecidos por la Comisión para el Mercado Financiero.

**g) Riesgo crédito de la contraparte:**

El Fondo está autorizado a transar sólo con entidades formales aprobadas por la Comisión para el Mercado Financiero, a través de los sistemas de transacción existentes en las bolsas de valores, tanto nacionales como extranjeros.

Las inversiones del Fondo en aquellos tipos de instrumentos indicados en el numeral 3 "Características y diversificación de las inversiones", señalados en el Reglamento Interno del fondo, deberán celebrarse con contrapartes nacionales que correspondan entre otros, a entidades bancarias, financieras, intermediarios de valores, agentes colocadores, y administradoras y/o gestores de fondos, reguladas por la Comisión para el Mercado Financiero.

Los contratos de futuros deberán tener como entidad contraparte a cámaras de compensación. Por su parte, los contratos de forward y swaps que se realicen tanto en Chile como en el extranjero deberán tener como contrapartes a entidades bancarias, financieras o intermediarios de valores, reguladas por la Comisión para el Mercado Financiero u otros organismos de similares competencias, o bien que cuenten con una clasificación de riesgo equivalente a B o superior a esta, a que se refieren los incisos segundo y tercero del artículo 88 de la Ley N°18.045.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**h) Riesgo crédito del emisor:**

Está estipulado en el Reglamento Interno del Fondo que los instrumentos de emisores nacionales en los que invierta el Fondo deberán contar con una clasificación de riesgo B, N-4 o superiores a éstas, a las que se refieren los incisos segundo y tercero del Artículo N° 88 de la Ley No. 18.045.

La siguiente Ilustración resume la calidad crediticia de la cartera de deuda del Fondo al 31 de diciembre de 2019 y 2018, en miles de pesos:

Rating	Al 31 de diciembre del 2019	% sobre el activo	Rating	Al 31 de diciembre del 2018	% sobre el activo
AAA	1.756.940	18,9497	AAA	1.304.416	19,6312
AA	2.208.643	23,8216	AA	1.396.241	21,0132
A	326.987	3,5268	A	253.171	3,8102
BBB	30.262	0,3264	BBB	-	-
BB	-	-	BB	-	-
B	-	-	B	-	-
C	-	-	C	-	-
N-1	49.877	0,5380	N-1	169.673	2,5535
N-2	-	-	N-2	-	-
N-3	-	-	N-3	-	-
N-4	-	-	N-4	-	-
NA	4.855.407	52,3686	NA	3.518.159	52,9477
<b>Total</b>	<b>9.228.116</b>	<b>99,5311</b>	<b>Total</b>	<b>6.641.660</b>	<b>99,9559</b>

Las fuentes de información respecto a las categorías de riesgo de los instrumentos nacionales en cartera son obtenidas desde la página web de la CMF. Para los instrumentos internacionales se utiliza Bloomberg.

**i) Definición categorías de riesgo de títulos de deuda de largo plazo:**

**Categoría AAA:** Corresponde a aquellos instrumentos que cuentan con la más alta capacidad de pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, la cual no se vería afectada ante posibles cambios en el emisor, en la industria a que pertenece o en la economía.

**Categoría AA:** Corresponde a aquellos instrumentos que cuentan con una muy alta capacidad de pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, la cual no se vería afectada en forma significativa ante posibles cambios en el emisor, en la industria a que pertenece o en la economía.

**Categoría A:** Corresponde a aquellos instrumentos que cuentan con una buena capacidad de pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, pero ésta es susceptible de deteriorarse levemente ante posibles cambios en el emisor, en la industria a que pertenece o en la economía.

**Categoría BBB:** Corresponde a aquellos instrumentos que cuentan con una suficiente capacidad de pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, pero ésta es susceptible de debilitarse ante posibles cambios en el emisor, en la industria a que pertenece o en la economía.

**Categoría BB:** Corresponde a aquellos instrumentos que cuentan con capacidad para el pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, pero ésta es variable y susceptible de deteriorarse ante posibles cambios en el emisor, en la industria a que pertenece o en la economía, pudiendo incurrirse en retraso en el pago de intereses y del capital.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

Categoría C: Corresponde a aquellos instrumentos que no cuentan con una capacidad de pago suficiente para el pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, existiendo alto riesgo de pérdida de capital e intereses.

Categoría D: Corresponde a aquellos instrumentos que no cuentan con una capacidad de pago suficiente para el pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, y que presentan incumplimiento efectivo de pago de intereses o capital, o requerimiento de quiebra en curso.

Categoría E: Corresponde a aquellos instrumentos cuyo emisor no posee información suficiente o no tiene información representativa para el período mínimo exigido para la clasificación, y además no existen garantías suficientes.

**j) Las categorías de clasificación de títulos de deuda de corto plazo son las siguientes:**

Nivel 1: Corresponde a aquellos instrumentos que cuentan con una muy alta capacidad de pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, la cual no se vería afectada en forma significativa ante posibles cambios en el emisor, en la industria a que pertenece o en la economía.

Nivel 2: Corresponde a aquellos instrumentos que cuentan con una buena capacidad de pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, pero ésta es susceptible de deteriorarse levemente ante posibles cambios en el emisor, en la industria a que pertenece o en la economía.

Nivel 3: Corresponde a aquellos instrumentos que cuentan con suficiente capacidad de pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados, pero ésta es susceptible de debilitarse ante posibles cambios en el emisor, en la industria a que pertenece o en la economía.

Nivel 4: Corresponde a aquellos instrumentos cuya capacidad de pago del capital e intereses en los términos y plazos pactados no reúne los requisitos para clasificar en los niveles N-1, N-2 o N-3.

Nivel 5: Corresponde a aquellos instrumentos cuyo emisor no posee información representativa para el período mínimo exigido para la clasificación, y además no existen garantías suficientes.

**k) Categoría de clasificación para los títulos representativos de capital**

Nivel 1: Corresponde a aquellos títulos accionarios que presentan una excelente combinación de solvencia y estabilidad en la rentabilidad del emisor y volatilidad de sus retornos.

Nivel 2: Corresponde a aquellos títulos accionarios que presentan una muy buena combinación de solvencia y estabilidad en la rentabilidad del emisor y volatilidad de sus retornos.

Nivel 3: Corresponde a aquellos títulos accionarios que presentan una buena combinación de solvencia y estabilidad en la rentabilidad del emisor y volatilidad de sus retornos.

Nivel 4: Corresponde a aquellos títulos accionarios que presentan una razonable combinación de solvencia y estabilidad en la rentabilidad del emisor y volatilidad de sus retornos.

Segunda clase: Corresponde a aquellos títulos accionarios que presentan una inadecuada combinación de solvencia y estabilidad en la rentabilidad del emisor y volatilidad de sus retornos.

Sin Información suficiente: Corresponde a aquellos títulos accionarios para los cuales no se dispone de información suficiente como para ser clasificados de acuerdo con los procedimientos de clasificación.

La exposición máxima al riesgo crediticio ante cualquier aumento del crédito al 31 de diciembre es el valor contable de los activos financieros como se describe a continuación:

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

<b>Tipos de activos</b>	<b>Al 31 de diciembre del 2019</b>	<b>Al 31 de diciembre del 2018</b>
Instrumentos de capitalización	-	-
Títulos de Deuda	9.228.116	6.641.660
Activos de Derivados	-	-
Otros Activos	-	-
<b>Total</b>	<b>9.228.116</b>	<b>6.641.660</b>

El Fondo no presenta inversiones en instrumentos de derivados que aumenten el nivel de exposición. Ninguno de estos activos ha sufrido pérdida de valor por concepto de riesgo de crédito, ni tampoco está vencido. Los instrumentos se encuentran en custodia nacional autorizadas.

**I) Estimación del Valor Razonable**

Se entiende por valor razonable de un activo o pasivo financiero en una fecha dada el importe por el que podría ser entregado o liquidado, respectivamente, en esa fecha entre dos partes, independientes y que actúen libre y prudentemente, en condiciones de mercado. La referencia más objetiva y habitual del valor razonable de un activo o pasivo financiero es el precio que se pagaría por él en un mercado organizado, transparente y profundo (“precio de cotización” o “precio de mercado”).

Cuando no existe precio de mercado para un determinado activo o pasivo financiero, se recurre para estimar su valor razonable al establecido en transacciones recientes de instrumentos análogos y, en su defecto, a modelos matemáticos de valoración suficientemente contrastados por la comunidad financiera internacional. En la utilización de estos modelos se tienen en consideración las peculiaridades específicas del activo o pasivo a valorar y, muy especialmente, los distintos tipos de riesgos que el activo o pasivo lleva asociados. No obstante, lo anterior, las propias limitaciones de los modelos de valoración desarrollados y las posibles inexactitudes en las hipótesis y parámetros exigidos por estos modelos pueden dar lugar a que el valor razonable estimado de un activo o pasivo no coincida exactamente con el precio al que el activo o pasivo podría ser entregado o liquidado en la fecha de su valoración.

El valor razonable de los derivados financieros incluidos en las carteras de negociación se asimila a su cotización diaria cuando existe un mercado activo para estos instrumentos financieros. Si, por alguna razón, no se puede establecer su cotización en una fecha dada, se recurre para valorarlos a métodos similares a los utilizados para valorar los derivados contratados en mercados no organizados. (“over the counter” u “OTC”).

El valor razonable de los derivados OTC (“valor actual” o “cierre teórico”) se determina mediante la suma de los flujos de efectivo futuros con origen en el instrumento, descontados a la fecha de la valoración; utilizándose en el proceso de valoración métodos reconocidos por los mercados financieros internacionales: “valor actual neto” (VAN), modelos de determinación de precios de opciones, etc.

El Fondo utiliza para los instrumentos de deuda los precios proporcionados por la agencia de servicios de fijación de precios Riskamerica la cual es utilizada a nivel de industria y cuyos servicios han sido autorizados por la Comisión para el Mercado Financiero, mientras que para los instrumentos de capital el Fondo utiliza el precio cierre publicado por emisores de cada instrumento en cartera, en el caso de instrumentos de capital emitidos en el mercado externo, estos son valorizados utilizando los precios proporcionados por los emisores de los instrumentos extranjeros.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

Se considera que un instrumento financiero es cotizado en un mercado activo si es posible obtener fácil y regularmente los precios cotizados ya sea de un mercado bursátil, operador, corredor, grupo de industria, servicio de fijación de precios, o agencia fiscalizadora, y esos precios representan transacciones de mercados reales que ocurren regularmente entre partes independientes y en condiciones de plena competencia.

La clasificación de mediciones a valores razonables de acuerdo con su jerarquía, que refleja la importancia de los “inputs” utilizados para la medición, se establece de acuerdo a los siguientes niveles:

<b>Nivel 1</b>	Valoración realizada utilizando directamente la propia cotización del instrumento financiero, observable y capturable de fuentes independientes, y referida a mercados activos. Se incluyen en este nivel los valores representativos de deuda cotizados, los instrumentos de capital cotizados, ciertos derivados y los Fondos de Inversión.
<b>Nivel 2</b>	Valoración mediante la aplicación de técnicas que utilizan variables obtenidas de datos observables en el mercado.
<b>Nivel 3</b>	Valoración mediante técnicas en las que se utilizan variables no obtenidas de datos observables en el mercado.

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el fondo no utiliza inputs que no estén basados en datos de mercado observables, de esta manera no ha clasificado ninguno de sus activos o pasivos financieros medidos a valor razonable como de Nivel 3.

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, las valoraciones a valor razonable realizadas sobre los diferentes instrumentos financieros derivados quedan encuadradas en el nivel 2 de la jerarquía de valores razonables, al estar referenciados a variables observables pero distintos de precios cotizados

La siguiente Ilustración analiza dentro de la jerarquía del valor razonable los activos y pasivos financieros del Fondo (por clase) medidos a valor razonable al 31 de diciembre del 2019, de acuerdo al siguiente detalle:

<b>Cartera de Inversión al 31 de diciembre del 2019</b>	<b>Nivel 1 M\$</b>	<b>Nivel 2 M\$</b>	<b>Nivel 3 M\$</b>	<b>Total M\$</b>
<b>Activos</b>				
Activos Financieros a valor razonable con efecto en resultado	-	-	-	-
Acciones y derechos preferentes de suscripción de acciones	-	-	-	-
Cuotas de Fondos de inversión y derechos preferentes	-	-	-	-
Cuotas de Fondos mutuos	-	-	-	-
Otros títulos de capitalización	-	-	-	-
Prima de opciones	-	-	-	-
Depósitos y/o pagarés de bancos e instituciones financieras	49.877	-	-	49.877
Bonos de bancos e instituciones financieras	4.322.832	-	-	4.322.832
Letras de crédito bancos e instituciones financieras	-	-	-	-
Pagarés de empresas	-	-	-	-
Bonos subordinados	-	-	-	-
Bonos de empresas y sociedades securitizadoras	-	-	-	-
Pagarés emitidos por estados y bancos centrales	-	-	-	-
Bonos emitidos por estados y bancos centrales	-	-	-	-
Otros títulos de deuda	4.855.407	-	-	4.855.407
Derivados	-	-	-	-
<b>Total activos</b>	<b>9.228.116</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>9.228.116</b>
<b>Pasivos</b>				
Pasivos financieros a valor razonable con efecto en resultados:	-	-	-	-
Derivados	-	-	-	-
<b>Total pasivos</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

La siguiente Ilustración analiza dentro de la jerarquía del valor razonable los activos y pasivos financieros del Fondo (por clase) medidos a valor razonable al 31 de diciembre del 2018, de acuerdo al siguiente detalle:

<b>Cartera de Inversión al 31 de diciembre del 2018</b>	<b>Nivel 1 M\$</b>	<b>Nivel 2 M\$</b>	<b>Nivel 3 M\$</b>	<b>Total M\$</b>
<b>Activos</b>				
Activos Financieros a valor razonable con efecto en resultado	-	-	-	-
Acciones y derechos preferentes de suscripción de acciones	-	-	-	-
Cuotas de Fondos de inversión y derechos preferentes	-	-	-	-
Cuotas de Fondos mutuos	-	-	-	-
Instrumentos de capitalización	-	-	-	-
Prima de opciones	-	-	-	-
Depósitos y/o pagarés de bancos e instituciones financieras	2.879.717	-	-	2.879.717
Bonos de bancos e instituciones financieras	-	-	-	-
Letras de crédito bancos e instituciones financieras	-	-	-	-
Pagarés de empresas	-	-	-	-
Bonos Subordinados	-	-	-	-
Bonos de empresas y sociedades securitizadoras	-	-	-	-
Pagarés emitidos por estados y bancos centrales	-	-	-	-
Bonos emitidos por estados y bancos centrales	3.761.943	-	-	3.761.943
Otros títulos de deuda	-	-	-	-
Derivados	-	-	-	-
<b>Total activos</b>	<b>6.641.660</b>	-	-	<b>6.641.660</b>
<b>Pasivos</b>	-	-	-	-
Pasivos financieros a valor razonable con efecto en resultados:	-	-	-	-
Derivados	-	-	-	-
<b>Total pasivos</b>	-	-	-	-

Valor Razonable de activos y pasivos financieros a costo amortizado.

El valor razonable a costo amortizado, corresponde a las remuneraciones de la sociedad, otros documentos y cuentas por pagar, rescates por pagar y cuentas por pagar a intermediarios. Son equivalentes al costo amortizado de dichos pasivos, son registrados a costo amortizado, correspondiendo a valores corrientes del cual el valor libro es equivalente al valor razonable.

**(8) Efectivo y efectivo equivalente**

**(a) La composición del rubro efectivo y efectivo equivalente, comprende los siguientes saldos**

<b>Detalle</b>	<b>31-12-2019 M\$</b>	<b>31-12-2018 M\$</b>
Efectivo en bancos	27.486	2.933
<b>Totales</b>	<b>27.486</b>	<b>2.933</b>

**(b) Apertura por moneda**

<b>Detalle</b>	<b>31-12-2019 M\$</b>	<b>31-12-2018 M\$</b>
Pesos chilenos	27.486	2.933
Otras monedas	-	-
<b>Saldo final</b>	<b>27.486</b>	<b>2.933</b>

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(c) Conciliación del efectivo y efectivo equivalente con el estado de flujo de efectivo**

Detalle	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
Sobregiro bancario utilizado para la gestión del efectivo	-	-
Total partidas de conciliación del efectivo y efectivo equivalente	-	-
Efectivo y efectivo equivalente	27.486	2.933
<b>Saldo efectivo y efectivo equivalente - estado de flujo de efectivo</b>	<b>27.486</b>	<b>2.933</b>

**(9) Activos financieros a valor razonable con efecto en resultados**

**(a) Composición de la cartera**

Instrumento	31 de diciembre de 2019			
	Nacional M\$	Extranjero M\$	Total M\$	% del total de activos
Títulos de renta variable:				
Acciones de sociedades anónimas abiertas	-	-	-	-
Cuotas de fondos mutuos	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-
Otros títulos de renta variable	-	-	-	-
Títulos de deuda:				
Depósitos a plazo y otros títulos de Bancos e Instituciones Financieras	49.877	-	49.877	0,5380
Títulos emitidos o garantizados por Estados o Bancos Centrales	5.124.488	-	5.124.488	55,2708
Títulos de deuda de corto plazo registrados	-	-	-	-
Bonos registrados	4.053.751	-	4.053.751	43,7223
Contratos sobre productos que consten en facturas (Ley N° 19.220)	-	-	-	-
Pagarés de empresas no registrados	-	-	-	-
Otros títulos de deuda	-	-	-	-
<b>Totales</b>	<b>9.228.116</b>	<b>-</b>	<b>9.228.116</b>	<b>99,5311</b>

Instrumento	31 de diciembre de 2018			
	Nacional M\$	Extranjero M\$	Total M\$	% del total de activos
Títulos de renta variable:				
Acciones de sociedades anónimas abiertas	-	-	-	-
Cuotas de fondos mutuos	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-
Otros títulos de renta variable	-	-	-	-
Títulos de deuda:				
Depósitos a plazo y otros títulos de Bancos e Instituciones Financieras	2.879.717	-	2.879.717	43,3393
Títulos emitidos o garantizados por Estados o Bancos Centrales	3.761.943	-	3.761.943	56,6166
Títulos de deuda de corto plazo registrados	-	-	-	-
Bonos registrados	-	-	-	-
Contratos sobre productos que consten en facturas (Ley N° 19.220)	-	-	-	-
Pagarés de empresas no registrados	-	-	-	-
Otros títulos de deuda	-	-	-	-
<b>Totales</b>	<b>6.641.660</b>	<b>-</b>	<b>6.641.660</b>	<b>99,9559</b>

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(b) Efecto en resultados**

Detalle	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
Resultados realizados	266.423	371.051
Resultados no realizados	676.700	(9.415)
<b>Total resultado</b>	<b>943.123</b>	<b>361.636</b>

**(c) Movimiento de activos financieros a valor razonable por resultados**

Detalle	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
Saldo inicial	6.641.660	4.050.967
Intereses	340.584	234.154
Aumento neto por cambios en el valor razonable	602.539	126.721
Adiciones	21.894.859	8.034.032
Ventas	(20.235.533)	(5.804.708)
Otros	(15.993)	494
<b>Saldo final</b>	<b>9.228.116</b>	<b>6.641.660</b>

**(10) Activos y pasivos financieros a costo amortizado**

**(a) Composición de la cartera**

Instrumento	31 de diciembre de 2019			
	Nacional M\$	Extranjero M\$	Total M\$	% del total de activos
Títulos de renta variable:				
Acciones de sociedades anónimas abiertas	-	-	-	-
Cuotas de fondos mutuos	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-
Otros títulos de renta variable	-	-	-	-
Títulos de deuda:				
Depósitos a plazo y otros títulos de Bancos e Instituciones Financieras	-	-	-	-
Títulos emitidos o garantizados por Estados o Bancos Centrales	-	-	-	-
Títulos de deuda de corto plazo registrados	-	-	-	-
Bonos registrados	-	-	-	-
Contratos sobre productos que consten en facturas (Ley N° 19.220)	-	-	-	-
Pagarés de empresas no registrados	-	-	-	-
Otros títulos de deuda	-	-	-	-
<b>Totales</b>	-	-	-	-

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

Instrumento	31 de diciembre de 2018			
	Nacional M\$	Extranjero M\$	Total M\$	% del total de activos
Títulos de renta variable:				
Acciones de sociedades anónimas abiertas	-	-	-	-
Cuotas de fondos mutuos	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-
Otros títulos de renta variable	-	-	-	-
Títulos de deuda:				
Depósitos a plazo y otros títulos de Bancos e Instituciones Financieras	-	-	-	-
Títulos emitidos o garantizados por Estados o Bancos Centrales	-	-	-	-
Títulos de deuda de corto plazo registrados	-	-	-	-
Bonos registrados	-	-	-	-
Contratos sobre productos que consten en facturas (Ley N° 19.220)	-	-	-	-
Pagarés de empresas no registrados	-	-	-	-
Otros títulos de deuda	-	-	-	-
<b>Totales</b>	-	-	-	-

**(b) Efecto en resultados**

Otros cambios netos en el valor razonable sobre activos financieros a costo amortizado (incluyendo los designados al inicio).

Detalle	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
Resultados realizados	-	-
Resultados no realizados	-	-
<b>Total ganancias</b>	-	-

**(c) Movimiento de activos financieros a costo amortizado**

Detalle	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
Saldo inicial	-	-
Intereses	-	-
Aumento neto por cambios en el valor razonable	-	-
Adiciones	-	-
Ventas	-	-
Otros	-	-
<b>Saldo final</b>	-	-

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(11) Cuentas y documentos por cobrar y por pagar**

**(a) Cuentas y documentos por cobrar**

La composición del saldo es la siguiente:

<b>Detalle</b>	<b>31-12-2019 M\$</b>	<b>31-12-2018 M\$</b>
Otras cuentas por cobrar	-	-
<b>Totales</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

**(b) Cuentas y documentos por pagar**

La composición del saldo es la siguiente:

<b>Detalle</b>	<b>31-12-2019 M\$</b>	<b>31-12-2018 M\$</b>
Otras cuentas por pagar	3.050	18.221
<b>Totales</b>	<b>3.050</b>	<b>18.221</b>

**(12) Partes relacionadas**

**(a) Remuneración por administración**

El Fondo es administrado por Zurich Chile Asset management Administradora General de Fondos S. A. (La Administradora).

El Fondo es administrado por Zurich Chile Asset Management Administradora General de Fondos S.A. La Administradora percibirá por la administración del Fondo una comisión sobre la base del valor del patrimonio neto de las series de cuotas del Fondo, pagaderos mensualmente utilizando una tasa anual de acuerdo al siguiente detalle:

<b>Serie</b>	<b>Tasa anual</b>
Serie A	Hasta un 1,00% anual (IVA incluido)

Se deja constancia que la tasa del IVA actualmente asciende a un 19%.

El total de remuneración por administración del período terminado al 31 de diciembre de 2019 y 2018 ascendió a M\$ 47.589 y M\$ 21.030, respectivamente.

El saldo por pagar al 31 de diciembre de 2019 y 2018 fue de M\$ 3.989 y M\$ 2.162, respectivamente.

Sin perjuicio de la comisión de administración, serán también de cargo del Fondo los siguientes gastos y costos: honorarios profesionales de abogados, auditores externos, mantención y custodia de los activos, entre otros, según lo establecido en el Reglamento Interno del Fondo.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(b) Tenencia de cuotas por la Administradora, entidades relacionadas a la misma y otros**

La administradora, sus personas relacionadas, sus accionistas y los trabajadores que representan al empleador o que tienen facultades generales de administración; mantienen cuotas del Fondo según se detalla a continuación:

**Al 31 de diciembre de 2019:**

SERIE A*						
Detalle	%	Número de cuotas a comienzos del ejercicio	Número de cuotas adquiridas en el año	Número de cuotas rescatadas en el año	Número de cuotas al cierre del período	Monto en pesos al cierre del período
Sociedad administradora	-	-	-	-	-	-
Personas relacionadas	6,0698	33.639,7221	3.135.938,7773	(2.711.462,1044)	458.116,3950	539.344.372
Entidades relacionadas	-	-	-	-	-	-
Accionistas de la sociedad administradora	-	-	-	-	-	-
Trabajadores que representen al empleador	-	-	-	-	-	-
Personal clave de la administración	-	-	-	-	-	-

SERIE B-APV*						
Detalle	%	Número de cuotas a comienzos del ejercicio	Número de cuotas adquiridas en el año	Número de cuotas rescatadas en el año	Número de cuotas al cierre del período	Monto en pesos al cierre del período
Sociedad administradora	-	-	-	-	-	-
Personas relacionadas	-	6.890,2084	-	(6.890,2084)	-	-
Entidades relacionadas	-	-	-	-	-	-
Accionistas de la sociedad administradora	-	-	-	-	-	-
Trabajadores que representen al empleador	-	-	-	-	-	-
Personal clave de la administración	-	-	-	-	-	-

Serie Z (ex EA-AM)*						
Detalle	%	Número de cuotas a comienzos del ejercicio	Número de cuotas adquiridas en el año	Número de cuotas rescatadas en el año	Número de cuotas al cierre del período	Monto en pesos al cierre del período
Sociedad administradora	-	-	-	-	-	-
Personas relacionadas	100,0000	36.344,1738	42.695,0580	(6.154,4836)	72.884,7482	84.897.452
Entidades relacionadas	-	-	-	-	-	-
Accionistas de la sociedad administradora	-	-	-	-	-	-
Trabajadores que representen al empleador	-	-	-	-	-	-
Personal clave de la administración	-	-	-	-	-	-

Serie CUI*						
Detalle	%	Número de cuotas a comienzos del ejercicio	Número de cuotas adquiridas en el año	Número de cuotas rescatadas en el año	Número de cuotas al cierre del período	Monto en pesos al cierre del período
Sociedad administradora	-	-	-	-	-	-
Personas relacionadas	100,0000	-	116.852,0000	-	116.852,0000	112.045.351
Entidades relacionadas	-	-	-	-	-	-
Accionistas de la sociedad administradora	-	-	-	-	-	-
Trabajadores que representen al empleador	-	-	-	-	-	-
Personal clave de la administración	-	-	-	-	-	-

\*La tenencia de cuotas por parte de la administradora, entidades relacionadas y los trabajadores que representan al empleador en sus cuotas al comienzo del ejercicio son distintas que las expresadas al cierre del ejercicio 2018, puesto que estas cuotas se encuentran incorporadas entidades relacionadas que al cierre del período actual no son relacionadas.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**Al 31 de diciembre de 2018:**

	%	Número de cuotas al comienzo del ejercicio	Número de cuotas adquiridas en el año	Número de cuotas rescatadas en el año	Número de cuotas al cierre del ejercicio	Monto en M\$ al cierre del ejercicio
<b>Serie A</b>						
Sociedad administradora						
Personas relacionadas						
Entidades relacionadas	0,1342	193.213,9522	8.662.383,7836	(843.289)	8.012.308,7358	8.482.848
Accionistas de la Sociedad Administradora						
Trabajadores que representen al empleador						

	%	Número de cuotas al comienzo del ejercicio	Número de cuotas adquiridas en el año	Número de cuotas rescatadas en el año	Número de cuotas al cierre del ejercicio	Monto en M\$ al cierre del ejercicio
<b>Serie EA-AM</b>						
Sociedad Administradora						
Personas relacionadas						
Entidades relacionadas	0,1		52.071,9310	(15.727,7576)	36.344,1734	37.958
Accionistas de la Sociedad Administradora						
Trabajadores que representen al empleador						

**(b) Transacciones con partes relacionadas**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, no existen operaciones entre el Fondo y otros administrados por Zurich Chile Asset management Administradora General de Fondos S.A.

**(13) Otros Activos y pasivos**

**(a) Otros Activos**

La composición del saldo es la siguiente:

Detalle	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
Cupones por cobrar	15.993	-
<b>Total pérdidas</b>	<b>15.993</b>	<b>-</b>

**(b) Otros Pasivos**

La composición del saldo es la siguiente:

Detalle	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
Disminuciones de Patrimonio	10.552	36.240
Comisiones y derechos de bolsa	780	367
Provisión gasto Sonda	-	-
Provisión gasto de auditoría	-	-
Provisión gastos legales	-	-
<b>Total pérdidas</b>	<b>11.332</b>	<b>36.607</b>

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(14) Intereses y reajustes**

La composición del saldo es la siguiente:

Detalle	31-12-2019 M\$	31-12-2018 M\$
Intereses y reajustes a valor razonable con efecto en resultados	340.584	234.154
<b>Total</b>	<b>340.584</b>	<b>234.154</b>

**(15) Otros gastos de operación**

La composición del saldo es la siguiente:

Al 31 de diciembre de 2019

Tipo Gasto	Monto del trimestre M\$	Monto acumulado período actual M\$	Monto acumulado período anterior M\$
Comisiones y derechos de Bolsa	960	2.439	2.328
Gastos Bancarios	-		131
Gastos de auditoría y Clasificadoras de riesgo	-		110
Software y soporte computacional	-		8.220
Gastos legales y otros	5.434	20.020	4.221
<b>Totales</b>	<b>6.394</b>	<b>22.459</b>	<b>15.010</b>
<b>% sobre el total de Activos</b>		<b>0,2422</b>	<b>0,2259</b>

**(16) Cuotas en circulación**

Al 31 de diciembre de 2019 las cuotas emitidas y pagadas del Fondo ascienden a 7.884.797,7196 valor es de M\$ 9.253.224 siendo el detalle de las cuotas vigentes el siguiente:

Detalle	SERIE A	SERIE B-APV	Serie Z (ex EA-AM)	Serie CUI	Total
Saldo de inicio	5.971.154,5279	219.028,0754	36.344,1733		6.226.526,7766
Colocaciones del período	14.027.300,5108	176.738,7941	42.695,0580	116.851,9996	14.363.586,3625
Disminuciones	(12.450.997,0171)	(248.163,9193)	(6.154,4831)		(12.705.315,4195)
Transferencias	-	-	-		-
<b>Saldo al cierre</b>	<b>7.547.458,0216</b>	<b>147.602,9502</b>	<b>72.884,7482</b>	<b>116.851,9996</b>	<b>7.884.797,7196</b>

Al 31 de diciembre de 2018 las cuotas emitidas y pagadas del Fondo ascienden a 6.226.526,7766 cuyo valor es de M\$ 6.587.603, siendo el detalle de las cuotas vigentes el siguiente:

Detalle	SERIE A	SERIE B-APV	Serie EA-AM	Total
Saldo de inicio	4.069.050,9801	-	-	4.069.050,9801
Colocaciones del período	7.050.492,9786	219.028,0754	52.071,9309	7.321.592,9849
Transferencias	-	-	-	-
Disminuciones	(5.148.389,4308)	-	(15.727,7576)	(5.164.117,1884)
<b>Saldo al cierre</b>	<b>5.971.154,5279</b>	<b>219.028,0754</b>	<b>36.344,1733</b>	<b>6.226.526,7766</b>

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(17) Valor económico de la cuota**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el Fondo no mantiene inversiones que se encuentren valorizadas por el método de la participación o al costo amortizado.

**(18) Inversión acumulada en acciones o en cuotas de Fondos de Inversión**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el Fondo no mantiene saldos de esta naturaleza.

**(19) Consolidación de subsidiarias o filiales e información de asociadas o coligadas**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el Fondo no mantiene saldos por estos tipos de inversiones.

**(20) Gravámenes y prohibiciones**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, no se presentan gravámenes ni prohibiciones que afecten los activos del Fondo.

**(21) Reparto de beneficios a los Aportantes**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, no se realizaron repartos de dividendos.

**(22) Rentabilidad del Fondo**

La rentabilidad del Fondo se presenta de acuerdo al siguiente detalle:

**Al 31 de diciembre de 2019**

<b>Serie A</b>			
Tipo de rentabilidad	Período actual %	Acumulada últimos 12 meses %	Acumulada últimos 24 meses %
Nominal	(10,0723)	(10,0723)	(15,5354)
Real	(7,6446)	(7,6446)	(10,7704)

<b>Serie B-APV</b>			
Tipo de rentabilidad	Período actual %	Acumulada últimos 12 meses %	Acumulada últimos 24 meses %
Nominal	(10,0032)	(10,0032)	-
Real	(7,5737)	(7,5737)	-

<b>Serie CUI</b>			
Tipo de rentabilidad	Período actual %	Acumulada últimos 12 meses %	Acumulada últimos 24 meses %
Nominal	-	-	-
Real	-	-	-

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

<b>Serie EA-AM</b>			
Tipo de rentabilidad	Período actual %	Acumulada últimos 12 meses %	Acumulada últimos 24 meses %
Nominal	(10,3366)	(10,3366)	-
Real	(7,9161)	(7,9161)	-

**Al 31 de diciembre de 2018**

<b>Serie A</b>			
Tipo de rentabilidad	Período actual %	Acumulada últimos 12 meses %	Acumulada últimos 24 meses %
Nominal	6,4680	6,4680	-
Real	3,5031	3,5031	-

**(23) Información estadística**

El detalle de la información estadística es la siguiente:

<b>2019</b>				
<b>Serie A</b>				
Mes	Fecha	Valor libro cuota \$	Patrimonio M\$	N° Aportantes
Enero	31-01-2019	1.066,2951	6.628.087	93
Febrero	28-02-2019	1.071,7679	7.574.816	106
Marzo	31-03-2019	1.093,6857	7.873.864	117
Abril	30-04-2019	1.102,7727	8.136.408	113
Mayo	31-05-2019	1.130,2742	9.309.321	112
Junio	30-06-2019	1.160,3216	9.413.583	120
Julio	31-07-2019	1.200,3044	10.387.430	128
Agosto	31-08-2019	1.228,2537	12.081.969	139
Septiembre	30-09-2019	1.222,8619	12.604.398	143
Octubre	31-10-2019	1.174,8013	10.605.958	121
Noviembre	30-11-2019	1.141,3791	8.600.094	83
Diciembre	31-12-2019	1.177,3086	8.885.688	82

<b>2019</b>				
<b>Serie B</b>				
Mes	Fecha	Valor libro cuota \$	Patrimonio M\$	N° Aportantes
Enero	31-01-2019	1.047,1954	275.875	21
Febrero	28-02-2019	1.052,2187	283.593	22
Marzo	31-03-2019	1.073,3397	309.211	23
Abril	30-04-2019	1.081,9817	323.246	25
Mayo	31-05-2019	1.109,0434	360.695	27
Junio	30-06-2019	1.138,6046	391.131	28
Julio	31-07-2019	1.177,9227	412.987	32
Agosto	31-08-2019	1.205,4365	300.341	28
Septiembre	30-09-2019	1.200,2274	280.791	26
Octubre	31-10-2019	1.153,1382	213.392	22
Noviembre	30-11-2019	1.120,4093	165.376	14
Diciembre	31-12-2019	1.155,7607	170.594	14

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

2019				
Serie Z ( ex EA-AM)				
Mes	Fecha	Valor libro cuota \$	Patrimonio M\$	N° Aportantes
Enero	31-01-2019	1.052,2331	35.634	1
Febrero	28-02-2019	1.057,9538	35.827	1
Marzo	31-03-2019	1.079,9253	39.914	1
Abril	30-04-2019	1.089,2794	36.256	1
Mayo	31-05-2019	1.116,8817	43.730	1
Junio	30-06-2019	1.145,3998	50.736	1
Julio	31-07-2019	1.185,3853	52.507	1
Agosto	31-08-2019	1.213,3836	62.710	1
Septiembre	30-09-2019	1.208,5671	62.461	1
Octubre	31-10-2019	1.161,5747	60.033	1
Noviembre	30-11-2019	1.128,7771	82.271	1
Diciembre	31-12-2019	1.164,8178	84.897	1

2019				
Serie CUI				
Mes	Fecha	Valor libro cuota \$	Patrimonio M\$	N° Aportantes
Enero	31-01-2019	-		
Febrero	28-02-2019	-	-	-
Marzo	31-03-2019	-	-	-
Abril	30-04-2019	-	-	-
Mayo	31-05-2019	-	-	-
Junio	30-06-2019	-	-	-
Julio	31-07-2019	-	-	-
Agosto	31-08-2019	1.000,3581	116.894	1
Septiembre	30-09-2019	995,9667	116.381	1
Octubre	31-10-2019	956,8234	111.807	1
Noviembre	30-11-2019	929,6025	108.626	1
Diciembre	31-12-2019	958,8655	112.045	1

**Al 31 de diciembre de 2018:**

2018				
Serie A				
Mes	Fecha	Valor libro cuota \$	Patrimonio M\$	N° Aportantes
Enero	31-01-2018	995,59050	4.270.815	15
Febrero	28-02-2018	1001,52630	4.329.323	15
Marzo	31-03-2018	1009,83610	4.415.367	17
Abril	30-04-2018	1014,48510	4.806.112	27
Mayo	31-05-2018	1017,45070	5.168.610	28
Junio	30-06-2018	1021,97100	5.434.820	29
Julio	31-07-2018	1027,78270	5.109.855	29
Agosto	31-08-2018	1037,61710	5.490.118	37
Septiembre	30-09-2018	1037,95860	5.641.436	45
Octubre	31-10-2018	1038,05510	5.787.487	48
Noviembre	30-11-2018	1047,93690	5.927.219	60
Diciembre	31-12-2018	1058,72710	6.321.823	83

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

2018				
Serie B-APV/APVC				
Mes	Fecha	Valor libro cuota \$	Patrimonio M\$	N° Aportantes
Enero	31-01-2018	-	-	-
Febrero	28-02-2018	-	-	-
Marzo	31-03-2018	-	-	-
Abril	30-04-2018	-	-	-
Mayo	31-05-2018	1.002,1508	12.984	2
Junio	30-06-2018	1.006,2432	13.037	2
Julio	31-07-2018	1.011,5909	15.832	2
Agosto	31-08-2018	1.020,8926	17.337	2
Septiembre	30-09-2018	1.020,8633	109.773	5
Octubre	31-10-2018	1.020,5807	121.126	8
Noviembre	30-11-2018	1.029,9275	124.989	13
Diciembre	31-12-2018	1.040,1476	227.822	20

2018				
Serie EA-AM				
Mes	Fecha	Valor libro cuota \$	Patrimonio M\$	N° Aportantes
Enero	31-01-2018	-	-	-
Febrero	28-02-2018	-	-	-
Marzo	31-03-2018	-	-	-
Abril	30-04-2018	999,3337	1.607	1
Mayo	31-05-2018	1001,7483	17.632	1
Junio	30-06-2018	1006,3269	27.240	1
Julio	31-07-2018	1012,3585	34.935	1
Agosto	31-08-2018	1022,4206	42.039	1
Septiembre	30-09-2018	1022,9760	35.364	1
Octubre	31-10-2018	1023,3479	39.157	1
Noviembre	30-11-2018	1033,4247	39.542	1
Diciembre	31-12-2018	1044,4152	37.958	1

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(24) Custodia de valores (Norma de Carácter General N°235 de 2009)**

El Fondo posee custodia de valores según el siguiente detalle:

<b>31-12-2019</b>	<b>Custodia Nacional</b>			<b>Custodia Extranjera</b>		
Entidades	Monto custodiado M\$	% sobre el total de inversiones (emisores nacionales)	% sobre el total de Activos del fondo	Monto custodiado M\$	% sobre el total de inversiones (emisores nacionales)	% sobre el total de Activos del fondo
Depósito Central de Valores Zurich Chile Asset Management Administradora general de fondos S.A.	9.228.116	100,00	99,5311	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
<b>Total Cartera Inversión en custodia</b>	<b>9.228.116</b>	<b>100,00</b>	<b>99,5311</b>	-	-	-

<b>31-12-2018</b>	<b>Custodia Nacional</b>			<b>Custodia Extranjera</b>		
Entidades	Monto custodiado M\$	% sobre el total de inversiones (emisores nacionales)	% sobre el total de Activos del fondo	Monto custodiado M\$	% sobre el total de inversiones (emisores nacionales)	% sobre el total de Activos del fondo
Deposito Central de Valores EuroAmerica Administradora general de fondos S.A.	6.641.660	100,00	99,9559	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
<b>Total cartera de inversiones en custodia</b>	<b>6.641.660</b>	<b>100,00</b>	<b>99,9559</b>	-	-	-

**(25) Garantía constituida por la Sociedad Administradora en beneficio del Fondo (Artículo N°3A Ley N°18.815 - Artículo N°226 Ley N°18.045)**

Al 31 de diciembre de 2019:

<b>Naturaleza</b>	<b>Emisor</b>	<b>Representante de los beneficiarios</b>	<b>Monto UF</b>	<b>Vigencia (desde-hasta)</b>
Póliza de seguro de garantía	Banco Bice	Banco Bice en representación de los aportantes	10.000	09-01-2019/10-01-2020

Al 31 de diciembre de 2018:

<b>Naturaleza</b>	<b>Emisor</b>	<b>Representante de los beneficiarios</b>	<b>Monto UF</b>	<b>Vigencia (desde-hasta)</b>
Póliza de seguro de garantía	Compañía de seguros de Credito Continental S.A.	Banco de Chile en representación de los aportantes	10.000	10-01-2018/10-01-2019

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

**(26) Excesos de inversión**

Fecha exceso	Emisor	Rut Emisor	% del Exceso	Límite Excedido	Causa del Exceso	Observación
-	-	-	-	-	-	-

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, el Fondo no registra excesos que informar.

**(27) Sanciones**

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, la Comisión para el Mercado Financiero (CMF) no ha impuesto sanciones a la Administradora

**(28) Hechos relevantes**

Mediante la Resolución Exenta N° 9758, emitida con fecha 31 de diciembre del 2019, La Comisión para el Mercado Financiero ha otorgado la autorización para la fusión de las sociedades Zurich Administradora General de Fondos S.A. –Sociedad Absorbida- y Zurich Chile Asset Management Administradora General de Fondos S.A. – Sociedad Absorbente. La fusión fue acordada en Juntas Extraordinarias de Accionistas de ambas sociedades celebradas con fecha 23 de mayo de 2019.

Durante el ejercicio terminado al 31 de diciembre de 2019, las características, términos y condiciones de las inversiones mantenidas por los aportantes de los fondos administrados por la Sociedad Administradora no sufrirán modificación alguna producto de la fusión señalada en los hechos relevantes de la Sociedad.

Con fecha 7 de noviembre de 2018, se designa como presidente del directorio de la Administradora a don Hernán Felipe Errazuriz Correa y se ratifica en su cargo a don Marco Salin Vizcarra como Gerente General de la Administradora.

**(29) Hechos posteriores**

(1) Con fecha 10 de enero de 2020 Zurich Chile Asset Management Administradora General de Fondos S.A., renovó Boleta de Garantía, la que tiene vigencia hasta el 10 de enero de 2021. La Boleta en Garantía corresponde a la N°0245924 por un monto de UF 10.000, que está tomada a favor del Banco BICE, quien actúa como representante de los beneficiarios.

(2) Durante los primeros meses del año 2020, los mercados financieros y la economía en general han estado afectados por la aparición del Coronavirus. El impacto de este virus ha sido muy significativo y los gobiernos han tomado decisiones y medidas drásticas para intentar contener lo que finalmente se convirtió en pandemia, buscando disminuir la velocidad de propagación de la enfermedad. Medidas tales como cierre de fronteras, cuarentenas parciales o totales, restricción de desplazamientos, lo que ha tenido un impacto importante en la actividad económica.

Los mercados financieros han reaccionado negativamente, afectando fuertemente a la baja los principales índices accionarios mundiales y locales. Adicionalmente, se ha producido una fuerte apreciación del dólar frente al peso chileno.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Notas a los Estados Financieros  
al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

Zurich Chile Asset Management Administradora General de Fondos S.A. cuenta con políticas de inversión y de administración de riesgo que buscan entre otras cosas enfrentar adecuadamente los requerimientos de rescate de los partícipes de los fondos bajo su administración. Es por ello que creemos que se está en buen pie para enfrentar las caídas de patrimonio experimentadas por efectos de rescates y valorización de las carteras de inversión.

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**1. ANEXO**

**1.1. Resumen de la cartera de inversiones**

**Al 31 de diciembre de 2019**

Instrumento	Monto invertido			% del total de activos
	Nacional M\$	Extranjero M\$	Total M\$	
Acciones de sociedades anónimas abiertas	-	-	-	-
Cuotas de Fondos mutuos	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-
Depósitos a plazo y otros títulos de Bancos e Instituciones Financieras	49.877	-	49.877	0,5380
Títulos emitidos o garantizados por Estados o Bancos Centrales	5.124.488	-	5.124.488	55,2708
Otros títulos de deuda	-	-	-	-
Bonos Registrados	4.053.751	-	4.053.751	43,7223
<b>Totales</b>	<b>9.228.116</b>	<b>-</b>	<b>9.228.116</b>	<b>99,5311</b>

**Al 31 de diciembre de 2018**

Instrumento	Monto invertido			% del total de activos
	Nacional M\$	Extranjero M\$	Total M\$	
Acciones de sociedades anónimas abiertas	-	-	-	-
Cuotas de Fondos mutuos	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-
Cuotas de fondos de inversión	-	-	-	-
Depósitos a plazo y otros títulos de Bancos e Instituciones Financieras	2.879.717	-	2.879.717	43,3393
Títulos emitidos o garantizados por Estados o Bancos Centrales	3.761.943	-	3.761.943	56,6166
Otros títulos de deuda	-	-	-	-
Bonos Registrados	-	-	-	-
<b>Totales</b>	<b>6.641.660</b>	<b>-</b>	<b>6.641.660</b>	<b>99,9559</b>

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**1.2. Estado de resultado devengado y realizado**

	<b>01-01-2019</b> <b>31-12-2019</b> <b>M\$</b>	<b>01-01-2018</b> <b>31-12-2018</b> <b>M\$</b>
Pérdida neta realizada de inversiones	266.423	371.051
Enajenación de acciones de sociedades anónimas	-	-
Enajenación de cuotas de Fondos de inversión	-	-
Enajenación de cuotas de Fondos mutuos	-	-
Enajenación de Certificados de Depósitos de Valores	-	-
Dividendos percibidos	-	-
Enajenación de títulos de deuda	-	-
Intereses percibidos en títulos de deuda	266.423	180.827
Enajenación de bienes raíces	-	-
Arriendo de bienes raíces	-	-
Enajenación de cuotas o derechos en comunidades sobre bienes muebles	-	-
Resultados por operaciones con instrumentos derivados	-	-
Otras inversiones y operaciones	-	190.224
Pérdida no realizada de inversiones	<u>(331.565)</u>	<u>(180.054)</u>
Valorización de acciones de sociedades anónimas	-	-
Valorización de cuotas de Fondos de inversión	-	-
Valorización de cuotas de Fondos mutuos	-	-
Valorización de certificados de Depósito de Valores	-	-
Valorización de títulos de deuda	(331.565)	(180.054)
Valorización de bienes raíces	-	-
Valorización de cuotas o derechos en comunidades sobre bienes muebles	-	-
Resultado por operaciones con instrumentos derivados	-	-
Otras inversiones y operaciones	-	-
Utilidad no realizada de inversiones	<u>1.008.265</u>	<u>170.639</u>
Valorización de acciones de sociedades anónimas	-	-
Valorización de cuotas de Fondos de inversión	-	-
Valorización de cuotas de Fondos mutuos	-	-
Valorización de Certificados de Depósitos de Valores	-	-
Dividendos devengados	-	-
Valorización de títulos de deuda	934.104	170.639
Intereses devengados de títulos de deuda	74.161	-
Valorización de bienes raíces	-	-
Arriendos devengados de bienes raíces	-	-
Valorización de cuotas o derechos en comunidades sobre bienes muebles	-	-
Resultado por operaciones con instrumentos derivados	-	-
Otras inversiones y operaciones	-	-
Gastos del período	<u>(70.048)</u>	<u>(36.040)</u>
Comisión de la sociedad administradora	(47.589)	(21.030)
Gastos operacionales del Fondo	<u>(22.459)</u>	<u>(15.010)</u>
Diferencias de cambio	<u>1.760</u>	<u>39</u>
<b>Resultado neto del período</b>	<b><u>874.835</u></b>	<b><u>325.635</u></b>

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH**  
**RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**1.3. Estado de utilidad para la distribución de dividendos**

	<b>01-01-2019</b> <b>31-12-2019</b> <b>M\$</b>	<b>01-01-2018</b> <b>31-12-2018</b> <b>M\$</b>
Beneficio neto percibido en el ejercicio	(135.190)	154.957
Utilidad neta realizada de inversiones	266.423	371.051
Pérdida no realizada de inversiones	(331.565)	(180.054)
Gastos del ejercicio	(70.048)	(36.040)
Saldo neto deudor de diferencias de cambio	-	-
Dividendos provisorios	-	-
Beneficio neto percibido acumulado de ejercicios anteriores	(825.009)	(970.551)
Utilidad (pérdida) realizada no distribuida	(825.009)	(460.989)
Utilidad (pérdida) realizado no distribuida inicial	(815.594)	(485.910)
Utilidad devengada acumulada realizada en ejercicio	170.639	25.332
Pérdida devengada acumulada realizada en ejercicio	(180.054)	(411)
Dividendos definitivos declarados	-	-
Pérdida devengada acumulada	-	(509.562)
Pérdida devengada acumulada inicial	(180.054)	(509.973)
Abono a pérdida devengada acumulada	180.054	411
Ajuste a resultado devengado acumulado	-	-
Por utilidad devengada en el ejercicio	-	-
Por pérdida devengada en el ejercicio	-	-
<b>Monto susceptible de distribuir</b>	<b>(960.199)</b>	<b>(815.594)</b>

FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND

Estados Complementarios a los Estados Financieros

2. ANEXO 2

2.1. Inversiones en valores o instrumentos emitidos por emisores nacionales

Al 31 de diciembre de 2019

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	Unidad de valorización				Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	Porcentajes		
											TIR valor par o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés				del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BAGRS-D	76129263	CL	BE	2032-09-01	1	AA	196	1.000.000	UF	1.3900	1	365	RC	33.351	UF	CL	0,00	0,00	0,3600
1	BAGRS-D	76129263	CL	BE	2032-09-01	1	AA	196	500.000	UF	1.3900	1	365	RC	16.676	UF	CL	0,00	0,00	0,1800
1	BAMAF	96875230	CL	BE	2030-12-15	1	A	66	500.000	UF	1.3900	1	365	RC	15.347	UF	CL	0,00	0,00	0,1660
1	BAMAF	96875230	CL	BE	2030-12-15	1	A	66	1.000.000	UF	1.3900	1	365	RC	30.694	UF	CL	0,00	0,00	0,3310
1	BAND-F	91144000	CL	BE	2039-09-25	1	AA	0	500.000	UF	2.2800	1	365	RC	15.407	UF	CL	0,00	0,00	0,1660
1	BAND-F	91144000	CL	BE	2039-09-25	1	AA	0	1.000.000	UF	2.2800	1	365	RC	30.814	UF	CL	0,00	0,00	0,3320
1	BARAU-F	93458000	CL	BE	2029-10-30	1	AA	1	500.000	UF	1.1800	1	365	RC	14.858	UF	CL	0,00	0,00	0,1600
1	BARAU-F	93458000	CL	BE	2029-10-30	1	AA	1	500.000	UF	1.1800	1	365	RC	14.858	UF	CL	0,00	0,00	0,1600
1	BARAU-F	93458000	CL	BE	2029-10-30	1	AA	1	500.000	UF	1.1800	1	365	RC	14.858	UF	CL	0,00	0,00	0,1600
1	BARAU-J	93458000	CL	BE	2020-09-01	1	AA	1	1.000.000	UF	1.0900	1	365	RC	29.012	UF	CL	0,00	0,00	0,3130
1	BARAU-P	93458000	CL	BE	2032-11-15	1	AA	1	1.500.000	UF	1.2100	1	365	RC	51.104	UF	CL	0,00	0,00	0,5510
1	BARAU-R	93458000	CL	BE	2035-04-01	1	AA	1	500.000	UF	2.0300	1	365	RC	17.142	UF	CL	0,00	0,00	0,1850
1	BARAU-R	93458000	CL	BE	2035-04-01	1	AA	1	500.000	UF	2.0300	1	365	RC	17.142	UF	CL	0,00	0,00	0,1850
1	BARAU-S	93458000	CL	BE	2026-11-15	1	AA	1	1.000.000	UF	1.1700	1	365	RC	30.666	UF	CL	0,00	0,00	0,3310
1	BARAU-S	93458000	CL	BE	2026-11-15	1	AA	1	500.000	UF	1.1700	1	365	RC	15.333	UF	CL	0,00	0,00	0,1650
1	BARAU-X	93458000	CL	BE	2043-10-10	1	AA	1	1.500.000	UF	2.0000	1	365	RC	48.252	UF	CL	0,00	0,00	0,5200
1	BAY3-A	76039669	CL	BE	2032-12-15	1	AA	153	1.000.000	UF	1.9100	1	365	RC	33.323	UF	CL	0,00	0,00	0,3590
1	BBBVM41113	97018000	CL	BB	2020-05-01	1	AAA	32	1.500.000	UF	0.5400	1	365	RC	43.022	UF	CL	0,00	0,00	0,4640
1	BBBVM41113	97018000	CL	BB	2020-05-01	1	AAA	32	500.000	UF	0.5400	1	365	RC	14.341	UF	CL	0,00	0,00	0,1550
1	BBECPD	85741000	CL	BE	2048-06-15	1	AA	2	1.000.000	UF	1.6900	1	365	RC	32.817	UF	CL	0,00	0,00	0,3540
1	BBK590314	97080000	CL	BB	2024-03-01	1	AA	2	2.000.000	UF	0.7600	1	365	RC	62.379	UF	CL	0,00	0,00	0,6730
1	BBK670316	97080000	CL	BB	2027-03-01	1	AA	2	2.000.000	UF	0.9700	1	365	RC	66.129	UF	CL	0,00	0,00	0,7020
1	BBNS-L0511	97018000	CL	BB	2021-05-01	1	AAA	32	1.000.000	UF	0.5000	1	365	RC	29.730	UF	CL	0,00	0,00	0,3210
1	BBNS-L0511	97018000	CL	BB	2021-05-01	1	AAA	32	2.000.000	UF	0.5000	1	365	RC	59.461	UF	CL	0,00	0,00	0,6410
1	BBNS-N0712	97018000	CL	BB	2022-07-01	1	AAA	32	2.000.000	UF	0.4500	1	365	RC	62.237	UF	CL	0,00	0,00	0,6710
1	BBNS-Q0513	97018000	CL	BB	2023-05-01	1	AAA	32	1.000.000	UF	0.5300	1	365	RC	31.446	UF	CL	0,00	0,00	0,3390
1	BBNS-Q0513	97018000	CL	BB	2023-05-01	1	AAA	32	1.000.000	UF	0.5300	1	365	RC	31.446	UF	CL	0,00	0,00	0,3390
1	BBNS-X0814	97018000	CL	BB	2024-08-01	1	AAA	32	2.000.000	UF	0.5600	1	365	RC	63.569	UF	CL	0,00	0,00	0,6860
1	BBNSA0515	97018000	CL	BB	2025-05-01	1	AAA	32	2.000.000	UF	0.6800	1	365	RC	63.771	UF	CL	0,00	0,00	0,6880
1	BBNSAK0118	97018000	CL	BB	2023-07-01	1	AAA	32	3.000.000	UF	0.5600	1	365	RC	90.347	UF	CL	0,00	0,00	0,9740
1	BBNSA00918	97018000	CL	BB	2028-09-01	1	AAA	32	3.000.000	UF	0.9700	1	365	RC	94.955	UF	CL	0,00	0,00	1,0240
1	BCALLA	96511530	CL	BE	2030-06-15	1	A	24	1.500.000	UF	2.6800	1	365	RC	48.240	UF	CL	0,00	0,00	0,5200
1	BCELEA	76187228	CL	BE	2047-06-22	1	A	165	1.000.000	UF	1.3800	1	365	RC	34.201	UF	CL	0,00	0,00	0,3690
1	BCELEA	76187228	CL	BE	2047-06-22	1	A	165	1.000.000	UF	1.3800	1	365	RC	34.201	UF	CL	0,00	0,00	0,3690
1	BCENC-N	93834000	CL	BE	2030-05-28	1	AA	199	1.000.000	UF	1.9000	1	365	RC	33.945	UF	CL	0,00	0,00	0,3660
1	BCENC-R	93834000	CL	BE	2041-11-07	1	AA	199	1.000.000	UF	2.2700	1	365	RC	30.479	UF	CL	0,00	0,00	0,3290
1	BCGED-E	99513400	CL	BE	2034-09-30	1	A	0	1.000.000	UF	2.1700	1	365	RC	34.034	UF	CL	0,00	0,00	0,3670
1	BCGED-I	76411321	CL	BE	2029-08-11	1	AA	18	1.000.000	UF	1.4700	1	365	RC	34.563	UF	CL	0,00	0,00	0,3730
1	BCMFC-F	96596540	CL	BE	2030-03-24	1	AA	2	1.500.000	UF	1.2500	1	365	RC	55.183	UF	CL	0,00	0,00	0,5950
1	BCMFC-F	96596540	CL	BE	2030-03-24	1	AA	2	500.000	UF	1.2500	1	365	RC	18.394	UF	CL	0,00	0,00	0,1980
1	BCMFC-G	96596540	CL	BE	2039-04-21	1	AA	2	1.000.000	UF	1.4800	1	365	RC	38.067	UF	CL	0,00	0,00	0,4110
1	BCMFC-G	96596540	CL	BE	2039-04-21	1	AA	2	1.000.000	UF	1.4800	1	365	RC	38.067	UF	CL	0,00	0,00	0,4110
1	BCODE-B	61704000	CL	BE	2025-04-01	1	AAA	21	1.000.000	UF	0.6400	1	365	RC	33.497	UF	CL	0,00	0,00	0,3610
1	BCODE-C	61704000	CL	BE	2026-08-24	1	AAA	21	1.000.000	UF	0.6900	1	365	RC	31.853	UF	CL	0,00	0,00	0,3440
1	BCODE-C	61704000	CL	BE	2026-08-24	1	AAA	21	2.000.000	UF	0.6900	1	365	RC	63.707	UF	CL	0,00	0,00	0,6870
1	BCORAD710	97023000	CL	BB	2020-07-01	1	AA	76	2.000.000	UF	0.3500	1	365	RC	58.218	UF	CL	0,00	0,00	0,6280
1	BCORAD710	97023000	CL	BB	2020-07-01	1	AA	76	500.000	UF	0.3500	1	365	RC	14.554	UF	CL	0,00	0,00	0,1570
1	BCORAK0710	97023000	CL	BB	2022-07-01	1	AA	76	500.000	UF	0.4400	1	365	RC	15.267	UF	CL	0,00	0,00	0,1650
1	BCORAK0710	97023000	CL	BB	2022-07-01	1	AA	76	1.500.000	UF	0.4400	1	365	RC	45.801	UF	CL	0,00	0,00	0,4940
1	BCORAM0710	97023000	CL	BB	2024-07-01	1	AA	76	1.500.000	UF	0.6300	1	365	RC	47.560	UF	CL	0,00	0,00	0,5130

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**Al 31 de diciembre de 2019**

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	Unidad de valorización				Porcentajes					
											TIR valor por o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BCORAN0710	97023000	CL	BB	2025-07-01	1	AA	76	500,0000	UF	0.6000	1	365	RC	16.202	UF	CL	0.00	0.00	0.1750
1	BCORAN0710	97023000	CL	BB	2025-07-01	1	AA	76	1,500,0000	UF	0.6000	1	365	RC	48.607	UF	CL	0.00	0.00	0.5240
1	BCORAN0710	97023000	CL	BB	2025-07-01	1	AA	76	500,0000	UF	0.6000	1	365	RC	16.202	UF	CL	0.00	0.00	0.1750
1	BCORAO0710	97023000	CL	BB	2026-07-01	1	AA	76	1,000,0000	UF	0.8400	1	365	RC	32.597	UF	CL	0.00	0.00	0.3520
1	BCORAO0710	97023000	CL	BB	2026-07-01	1	AA	76	1,000,0000	UF	0.8400	1	365	RC	32.597	UF	CL	0.00	0.00	0.3520
1	BCORAO0710	97023000	CL	BB	2026-07-01	1	AA	76	500,0000	UF	0.8400	1	365	RC	16.299	UF	CL	0.00	0.00	0.1760
1	BCP0450420	97029000	CL	BCP	2020-04-01	1	NA	0	40,000,000,000	\$\$	1.8700	1	365	RC	40.709	\$\$	CL	0.00	0.00	0.4390
1	BCP0450620	97029000	CL	BCP	2020-06-01	1	NA	0	50,000,000,000	\$\$	1.8100	1	365	RC	50.740	\$\$	CL	0.00	0.00	0.5470
1	BCP0450620	97029000	CL	BCP	2020-06-01	1	NA	0	5,000,000,000	\$\$	1.8100	1	365	RC	5.074	\$\$	CL	0.00	0.00	0.0550
1	BCP0450620	97029000	CL	BCP	2020-06-01	1	NA	0	5,000,000,000	\$\$	1.8100	1	365	RC	5.074	\$\$	CL	0.00	0.00	0.0550
1	BCP0450620	97029000	CL	BCP	2020-06-01	1	NA	0	5,000,000,000	\$\$	1.8100	1	365	RC	5.074	\$\$	CL	0.00	0.00	0.0550
1	BCP0450620	97029000	CL	BCP	2020-06-01	1	NA	0	5,000,000,000	\$\$	1.8100	1	365	RC	5.074	\$\$	CL	0.00	0.00	0.0550
1	BCP0600221	97029000	CL	BCP	2021-02-01	1	NA	0	40,000,000,000	\$\$	1.8500	1	365	RC	42.771	\$\$	CL	0.00	0.00	0.4610
1	BCP0600221	97029000	CL	BCP	2021-02-01	1	NA	0	5,000,000,000	\$\$	1.8500	1	365	RC	5.346	\$\$	CL	0.00	0.00	0.0580
1	BCP0600221	97029000	CL	BCP	2021-02-01	1	NA	0	5,000,000,000	\$\$	1.8500	1	365	RC	5.346	\$\$	CL	0.00	0.00	0.0580
1	BCP0600322	97029000	CL	BCP	2022-03-01	1	NA	0	35,000,000,000	\$\$	2.0300	1	365	RC	38.637	\$\$	CL	0.00	0.00	0.4170
1	BCP0600323	97029000	CL	BCP	2023-03-01	1	NA	0	25,000,000,000	\$\$	2.2100	1	365	RC	28.391	\$\$	CL	0.00	0.00	0.3060
1	BCSSA-A	78433310	CL	BE	2029-04-25	1	AA	199	1,500,0000	UF	1.2100	1	365	RC	45.164	UF	CL	0.00	0.00	0.4870
1	BCSSA-A	78433310	CL	BE	2029-04-25	1	AA	199	500,0000	UF	1.2100	1	365	RC	15.055	UF	CL	0.00	0.00	0.1620
1	BCSSA-E	78433310	CL	BE	2045-03-01	1	AA	199	1,500,0000	UF	2.1000	1	365	RC	35.651	UF	CL	0.00	0.00	0.3850
1	BCU0300221	97029000	CL	BCU	2021-02-01	1	NA	0	500,0000	UF	-0.4300	1	365	RC	14.860	UF	CL	0.00	0.00	0.1600
1	BCU0300221	97029000	CL	BCU	2021-02-01	1	NA	0	500,0000	UF	-0.4300	1	365	RC	14.860	UF	CL	0.00	0.00	0.1600
1	BCU0300221	97029000	CL	BCU	2021-02-01	1	NA	0	500,0000	UF	-0.4300	1	365	RC	14.860	UF	CL	0.00	0.00	0.1600
1	BCU0300221	97029000	CL	BCU	2021-02-01	1	NA	0	2,500,0000	UF	-0.4300	1	365	RC	74.301	UF	CL	0.00	0.00	0.8010
1	BCU0300231	97029000	CL	BCU	2031-02-01	1	NA	0	500,0000	UF	0.3500	1	365	RC	18.406	UF	CL	0.00	0.00	0.1990
1	BCU0300322	97029000	CL	BCU	2022-03-01	1	NA	0	500,0000	UF	-0.4000	1	365	RC	15.345	UF	CL	0.00	0.00	0.1660
1	BCU0300322	97029000	CL	BCU	2022-03-01	1	NA	0	1,500,0000	UF	-0.4000	1	365	RC	46.034	UF	CL	0.00	0.00	0.4970
1	BCU0300322	97029000	CL	BCU	2022-03-01	1	NA	0	500,0000	UF	-0.4000	1	365	RC	15.345	UF	CL	0.00	0.00	0.1660
1	BCU0300323	97029000	CL	BCU	2023-03-01	1	NA	0	1,000,0000	UF	-0.4600	1	365	RC	31.721	UF	CL	0.00	0.00	0.3420
1	BCU0500922	97029000	CL	BCU	2022-09-01	1	NA	0	1,000,0000	UF	-0.4200	1	365	RC	32.901	UF	CL	0.00	0.00	0.3550
1	BEVA-P-F	92604000	CL	BE	2027-05-08	1	AAA	21	1,000,0000	UF	1.3300	1	365	RC	29.805	UF	CL	0.00	0.00	0.3210
1	BEVA-E-M	91081000	CL	BE	2029-12-15	1	AA	15	2,000,0000	UF	1.1900	1	365	RC	60.583	UF	CL	0.00	0.00	0.6530
1	BEVA-E-M	92580000	CL	BE	2035-05-30	1	A	27	500,0000	UF	2.0500	1	365	RC	16.861	UF	CL	0.00	0.00	0.1820
1	BEVA-E-M	92580000	CL	BE	2035-05-30	1	A	27	500,0000	UF	2.0500	1	365	RC	16.861	UF	CL	0.00	0.00	0.1820
1	BEVA-E-M	92580000	CL	BE	2035-05-30	1	A	27	1,500,0000	UF	2.0500	1	365	RC	50.583	UF	CL	0.00	0.00	0.5460
1	BEVA-E-N	92580000	CL	BE	2028-11-01	1	A	27	1,500,0000	UF	1.4400	1	365	RC	45.964	UF	CL	0.00	0.00	0.4960
1	BESS-D	78833300	CL	BE	2029-11-15	1	AA	75	1,000,0000	UF	1.3600	1	365	RC	33.973	UF	CL	0.00	0.00	0.3660
1	BIEL-C-E	76022072	CL	BE	2031-06-30	1	AA	53	1,000,0000	UF	1.7800	1	365	RC	34.841	UF	CL	0.00	0.00	0.3760
1	BIEL-C-J	76022072	CL	BE	2048-06-30	1	AA	53	1,000,0000	UF	1.7800	1	365	RC	29.240	UF	CL	0.00	0.00	0.3150
1	BINT-ID318	97011000	CL	BB	2023-03-01	1	AA	136	50,000,000,000	\$\$	3.7100	1	365	RC	52.367	\$\$	CL	0.00	0.00	0.5650
1	BINT-J0318	97011000	CL	BB	2023-03-01	1	AA	136	2,000,0000	UF	0.4100	1	365	RC	59.808	UF	CL	0.00	0.00	0.6450
1	BITAA-G0614	97023000	CL	BB	2024-06-01	1	AA	76	2,000,0000	UF	0.6200	1	365	RC	63.804	UF	CL	0.00	0.00	0.6880
1	BLATM-E	89662200	CL	BE	2029-04-15	1	BBB	185	1,000,0000	UF	2.8300	1	365	RC	30.262	UF	CL	0.00	0.00	0.3260
1	BLOF-D	96929880	CL	BE	2033-05-15	1	AA	3	1,000,0000	UF	0.9800	1	365	RC	34.270	UF	CL	0.00	0.00	0.3700
1	BNTRA-D	76555400	CL	BE	2027-12-15	1	AA	187	2,000,0000	UF	1.2300	1	365	RC	69.469	UF	CL	0.00	0.00	0.7490
1	BNTRA-D	76555400	CL	BE	2027-12-15	1	AA	187	1,000,0000	UF	1.2300	1	365	RC	34.734	UF	CL	0.00	0.00	0.3750
1	BQUIN-R	91705000	CL	BE	2039-06-01	1	AA	3	1,000,0000	UF	1.9300	1	365	RC	34.007	UF	CL	0.00	0.00	0.3670
1	BSECK41013	97053000	CL	BB	2023-10-01	1	AA	35	1,500,0000	UF	0.5400	1	365	RC	47.664	UF	CL	0.00	0.00	0.5140

**Al 31 de diciembre de 2019**

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TIR valor por o precio	Unidad de valorización				Porcentajes				
												Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BSECK70915	97053000	CL	BB	2025-09-01	1	AA	35	1.000.0000	UF	0,7800	1	365	RC	31.655	UF	CL	0,00	0,00	0,3410
1	BSECK70915	97053000	CL	BB	2025-09-01	1	AA	35	500.0000	UF	0,7800	1	365	RC	15.828	UF	CL	0,00	0,00	0,1710
1	BSTD010216	97036000	CL	BB	2020-02-01	1	AAA	14	1.000.0000	UF	1,4000	1	365	RC	28.586	UF	CL	0,00	0,00	0,3080
1	BSTD010216	97036000	CL	BB	2020-02-01	1	AAA	14	1.000.0000	UF	1,4000	1	365	RC	28.586	UF	CL	0,00	0,00	0,3080
1	BSTD010216	97036000	CL	BB	2020-02-01	1	AAA	14	1.000.0000	UF	1,4000	1	365	RC	28.586	UF	CL	0,00	0,00	0,3080
1	BSTD040216	97036000	CL	BB	2021-08-01	1	AAA	14	2.000.0000	UF	0,4300	1	365	RC	58.888	UF	CL	0,00	0,00	0,6350
1	BSTD080216	97036000	CL	BB	2023-08-01	1	AAA	14	2.000.0000	UF	0,5400	1	365	RC	61.254	UF	CL	0,00	0,00	0,6610
1	BSTD140216	97036000	CL	BB	2027-02-01	1	AAA	14	6.000.0000	UF	0,8000	1	365	RC	195.189	UF	CL	0,00	0,00	2,1050
1	BSTD940315	97036000	CL	BB	2020-03-01	1	AAA	14	50.000.000.0000	\$\$	2,6400	1	365	RC	50.979	\$\$	CL	0,00	0,00	0,5500
1	BSTD950315	97036000	CL	BB	2022-03-01	1	AAA	14	50.000.000.0000	\$\$	2,6800	1	365	RC	53.641	\$\$	CL	0,00	0,00	0,5790
1	BSTD990315	97036000	CL	BB	2025-09-01	1	AAA	14	2.000.0000	UF	0,6700	1	365	RC	63.177	UF	CL	0,00	0,00	0,6810
1	BSTDRI0915	97036000	CL	BB	2021-03-01	1	AAA	14	4.000.0000	UF	0,3100	1	365	RC	117.065	UF	CL	0,00	0,00	1,2630
1	BSTDRI0915	97036000	CL	BB	2026-03-01	1	AAA	14	3.000.0000	UF	0,6800	1	365	RC	97.660	UF	CL	0,00	0,00	1,0530
1	BSTDRI1215	97036000	CL	BB	2022-12-01	1	AAA	14	2.000.0000	UF	0,5100	1	365	RC	60.080	UF	CL	0,00	0,00	0,6480
1	BSTDRI1215	97036000	CL	BB	2022-12-01	1	AAA	14	1.000.0000	UF	0,5100	1	365	RC	30.040	UF	CL	0,00	0,00	0,3240
1	BSTDSDA0714	97036000	CL	BB	2024-07-01	1	AAA	14	1.000.0000	UF	0,4800	1	365	RC	31.908	UF	CL	0,00	0,00	0,3440
1	BSTDSDC0614	97036000	CL	BB	2024-06-01	1	AAA	14	60.000.000.0000	\$\$	3,2500	1	365	RC	66.970	\$\$	CL	0,00	0,00	0,7220
1	BSXXIA	76317736	CL	BE	2030-04-30	1	AAA	161	1.500.0000	UF	1,0300	1	365	RC	41.146	UF	CL	0,00	0,00	0,4440
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	100.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	106.782	\$\$	CL	0,00	0,00	1,1520
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	5.339	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0580
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	5.339	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0580
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	10.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	10.678	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1150
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	15.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	16.017	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1730
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	5.339	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0580
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	5.339	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0580
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	10.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	10.678	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1150
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	5.339	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0580
1	BTP0400323	60805000	CL	BTP	2023-03-01	1	NA	0	50.000.000.0000	\$\$	2,2200	1	365	RC	53.391	\$\$	CL	0,00	0,00	0,5760
1	BTP0450221	60805000	CL	BTP	2021-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	1,8000	1	365	RC	5.231	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0560
1	BTP0450221	60805000	CL	BTP	2021-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	1,8000	1	365	RC	5.231	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0560
1	BTP0450221	60805000	CL	BTP	2021-03-01	1	NA	0	50.000.000.0000	\$\$	1,8000	1	365	RC	52.307	\$\$	CL	0,00	0,00	0,5640
1	BTP0450221	60805000	CL	BTP	2021-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	1,8000	1	365	RC	5.231	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0560
1	BTP0450321	60805000	CL	BTP	2021-03-01	1	NA	0	140.000.000.0000	\$\$	1,8300	1	365	RC	146.399	\$\$	CL	0,00	0,00	1,5790
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	100.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	111.938	\$\$	CL	0,00	0,00	1,2070
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	5.597	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0600
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	20.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	22.388	\$\$	CL	0,00	0,00	0,2410
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	5.597	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0600
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	15.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	16.791	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1810
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	20.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	22.388	\$\$	CL	0,00	0,00	0,2410
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	10.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	11.194	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1210
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	10.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	11.194	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1210
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	15.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	16.791	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1810
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	5.597	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0600
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	90.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	100.744	\$\$	CL	0,00	0,00	1,0870
1	BTP0450326	60805000	CL	BTP	2026-03-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	2,6700	1	365	RC	5.597	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0600
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	5.000.000.0000	\$\$	3,1400	1	365	RC	5.791	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0620
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	10.000.000.0000	\$\$	3,1400	1	365	RC	11.582	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1250
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	65.000.000.0000	\$\$	3,1400	1	365	RC	75.282	\$\$	CL	0,00	0,00	0,8120
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	25.000.000.0000	\$\$	3,1400	1	365	RC	28.955	\$\$	CL	0,00	0,00	0,3120

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**Al 31 de diciembre de 2019**

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	Unidad de valorización				Porcentajes					
											TIR valor por o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	60.000.000.000	\$\$	3.1400	1	365	RC	69.491	\$\$	CL	0,00	0,00	0,7500
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	50.000.000.000	\$\$	3.1400	1	365	RC	57.909	\$\$	CL	0,00	0,00	0,6250
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	15.000.000.000	\$\$	3.1400	1	365	RC	17.373	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1870
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.1400	1	365	RC	5.791	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0620
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.1400	1	365	RC	5.791	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0620
1	BTP0470930	60805000	CL	BTP	2030-09-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.1400	1	365	RC	5.791	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0620
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	5.965	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0640
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	10.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	11.931	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1290
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	5.965	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0640
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	15.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	17.896	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1930
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	15.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	17.896	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1930
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	35.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	41.757	\$\$	CL	0,00	0,00	0,4500
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	35.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	41.757	\$\$	CL	0,00	0,00	0,4500
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	50.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	59.653	\$\$	CL	0,00	0,00	0,6430
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	50.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	59.653	\$\$	CL	0,00	0,00	0,6430
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	20.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	23.861	\$\$	CL	0,00	0,00	0,2570
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	20.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	23.861	\$\$	CL	0,00	0,00	0,2570
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	5.965	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0640
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	10.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	11.931	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1290
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	50.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	59.653	\$\$	CL	0,00	0,00	0,6430
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	10.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	11.931	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1290
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	15.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	17.896	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1930
1	BTP0500335	60805000	CL	BTP	2035-03-01	1	NA	0	20.000.000.000	\$\$	3.5200	1	365	RC	24.793	\$\$	CL	0,00	0,00	0,2670
1	BTP0510750	60805000	CL	BTP	2050-07-15	1	NA	0	45.000.000.000	\$\$	3.9200	1	365	RC	55.785	\$\$	CL	0,00	0,00	0,6020
1	BTP0510750	60805000	CL	BTP	2050-07-15	1	NA	0	30.000.000.000	\$\$	3.9200	1	365	RC	37.190	\$\$	CL	0,00	0,00	0,4010
1	BTP0600120	60805000	CL	BTP	2020-01-01	1	NA	0	20.000.000.000	\$\$	1.9600	1	365	RC	20.599	\$\$	CL	0,00	0,00	0,2220
1	BTP0600120	60805000	CL	BTP	2020-01-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	1.9600	1	365	RC	5.150	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0560
1	BTP0600122	60805000	CL	BTP	2022-01-01	1	NA	0	20.000.000.000	\$\$	2.0000	1	365	RC	22.163	\$\$	CL	0,00	0,00	0,2390
1	BTP0600124	60805000	CL	BTP	2024-01-01	1	NA	0	10.000.000.000	\$\$	2.3900	1	365	RC	11.674	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1260
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	10.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	13.993	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1510
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	35.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	48.977	\$\$	CL	0,00	0,00	0,5280
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	20.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	27.987	\$\$	CL	0,00	0,00	0,3020
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	10.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	13.993	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1510
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	20.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	27.987	\$\$	CL	0,00	0,00	0,3020
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	15.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	20.990	\$\$	CL	0,00	0,00	0,2260
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	10.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	13.993	\$\$	CL	0,00	0,00	0,1510
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	6.997	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0750
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	6.997	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0750
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	50.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	69.987	\$\$	CL	0,00	0,00	0,7550
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	25.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	34.984	\$\$	CL	0,00	0,00	0,3770
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	6.997	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0750
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	6.997	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0750
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	20.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	27.987	\$\$	CL	0,00	0,00	0,3020
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	6.997	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0750
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	6.997	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0750
1	BTP0600143	60805000	CL	BTP	2043-01-01	1	NA	0	5.000.000.000	\$\$	3.6500	1	365	RC	6.997	\$\$	CL	0,00	0,00	0,0750
1	BTU0130323	60805000	CL	BTU	2023-03-01	1	NA	0	4.000.000	UF	-0.4500	1	365	RC	120.062	UF	CL	0,00	0,00	1,2950
1	BTU0130323	60805000	CL	BTU	2023-03-01	1	NA	0	1.000.000	UF	-0.4500	1	365	RC	30.015	UF	CL	0,00	0,00	0,3240

**Al 31 de diciembre de 2019**

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

**Estados Complementarios a los Estados Financieros**

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TIR valor por o precio	Unidad de valorización				Porcentajes				
												Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BTU0150321	60805000	CL	BTU	2021-03-01	1	NA	0	6.500.000	UF	-0,4300	1	365	RC	189.089	UF	CL	0,00	0,00	2.0390
1	BTU0150321	60805000	CL	BTU	2021-03-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,4300	1	365	RC	14.545	UF	CL	0,00	0,00	0.1570
1	BTU0150321	60805000	CL	BTU	2021-03-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,4300	1	365	RC	14.545	UF	CL	0,00	0,00	0.1570
1	BTU0150321	60805000	CL	BTU	2021-03-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,4300	1	365	RC	14.545	UF	CL	0,00	0,00	0.1570
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,0100	1	365	RC	15.544	UF	CL	0,00	0,00	0.1680
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,0100	1	365	RC	15.544	UF	CL	0,00	0,00	0.1680
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	2.500.000	UF	-0,0100	1	365	RC	77.719	UF	CL	0,00	0,00	0.8380
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,0100	1	365	RC	15.544	UF	CL	0,00	0,00	0.1680
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	5.000.000	UF	-0,0100	1	365	RC	155.439	UF	CL	0,00	0,00	1.6770
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	2.000.000	UF	-0,0100	1	365	RC	62.176	UF	CL	0,00	0,00	0.6710
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	1.000.000	UF	-0,0100	1	365	RC	31.088	UF	CL	0,00	0,00	0.3350
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	2.000.000	UF	-0,0100	1	365	RC	62.176	UF	CL	0,00	0,00	0.6710
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,0100	1	365	RC	15.544	UF	CL	0,00	0,00	0.1680
1	BTU0150326	60805000	CL	BTU	2026-03-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,0100	1	365	RC	15.544	UF	CL	0,00	0,00	0.1680
1	BTU0190930	60805000	CL	BTU	2030-09-01	1	NA	0	500.000	UF	0,3300	1	365	RC	16.571	UF	CL	0,00	0,00	0.1790
1	BTU0190930	60805000	CL	BTU	2030-09-01	1	NA	0	500.000	UF	0,3300	1	365	RC	16.571	UF	CL	0,00	0,00	0.1790
1	BTU0190930	60805000	CL	BTU	2030-09-01	1	NA	0	500.000	UF	0,3300	1	365	RC	16.571	UF	CL	0,00	0,00	0.1790
1	BTU0190930	60805000	CL	BTU	2030-09-01	1	NA	0	1.000.000	UF	0,3300	1	365	RC	33.143	UF	CL	0,00	0,00	0.3570
1	BTU0190930	60805000	CL	BTU	2030-09-01	1	NA	0	1.000.000	UF	0,3300	1	365	RC	33.143	UF	CL	0,00	0,00	0.3570
1	BTU0190930	60805000	CL	BTU	2030-09-01	1	NA	0	2.500.000	UF	0,3300	1	365	RC	82.857	UF	CL	0,00	0,00	0.8940
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	500.000	UF	0,5500	1	365	RC	17.232	UF	CL	0,00	0,00	0.1860
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	500.000	UF	0,5500	1	365	RC	17.232	UF	CL	0,00	0,00	0.1860
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	500.000	UF	0,5500	1	365	RC	17.232	UF	CL	0,00	0,00	0.1860
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	5.000.000	UF	0,5500	1	365	RC	172.322	UF	CL	0,00	0,00	1.8590
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	2.000.000	UF	0,5500	1	365	RC	68.929	UF	CL	0,00	0,00	0.7430
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	1.000.000	UF	0,5500	1	365	RC	34.464	UF	CL	0,00	0,00	0.3720
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	1.000.000	UF	0,5500	1	365	RC	34.464	UF	CL	0,00	0,00	0.3720
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	1.000.000	UF	0,5500	1	365	RC	34.464	UF	CL	0,00	0,00	0.3720
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	500.000	UF	0,5500	1	365	RC	17.232	UF	CL	0,00	0,00	0.1860
1	BTU0200335	60805000	CL	BTU	2035-03-01	1	NA	0	500.000	UF	0,5500	1	365	RC	17.232	UF	CL	0,00	0,00	0.1860
1	BTU0210750	60805000	CL	BTU	2050-07-15	1	NA	0	1.000.000	UF	0,9000	1	365	RC	37.649	UF	CL	0,00	0,00	0.4060
1	BTU0210750	60805000	CL	BTU	2050-07-15	1	NA	0	1.000.000	UF	0,9000	1	365	RC	37.649	UF	CL	0,00	0,00	0.4060
1	BTU0210750	60805000	CL	BTU	2050-07-15	1	NA	0	500.000	UF	0,9000	1	365	RC	18.825	UF	CL	0,00	0,00	0.2030
1	BTU0300120	60805000	CL	BTU	2020-01-01	1	NA	0	500.000	UF	5,5000	1	365	RC	14.365	UF	CL	0,00	0,00	0.1550
1	BTU0300120	60805000	CL	BTU	2020-01-01	1	NA	0	500.000	UF	5,5000	1	365	RC	14.365	UF	CL	0,00	0,00	0.1550
1	BTU0300124	60805000	CL	BTU	2024-01-01	1	NA	0	500.000	UF	-0,3300	1	365	RC	16.267	UF	CL	0,00	0,00	0.1750
1	BTU0300130	60805000	CL	BTU	2030-01-01	1	NA	0	500.000	UF	0,1600	1	365	RC	18.353	UF	CL	0,00	0,00	0.1980
1	BTU0300140	60805000	CL	BTU	2040-01-01	1	NA	0	500.000	UF	0,7400	1	365	RC	20.306	UF	CL	0,00	0,00	0.2190
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0.2300
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0.2300
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	1.000.000	UF	0,7600	1	365	RC	42.629	UF	CL	0,00	0,00	0.4600
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0.2300
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	1.000.000	UF	0,7600	1	365	RC	42.629	UF	CL	0,00	0,00	0.4600
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	5.000.000	UF	0,7600	1	365	RC	213.146	UF	CL	0,00	0,00	2.2990
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0.2300
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0.2300
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0.2300

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	Unidad de valorización				Porcentajes					
											TIR valor por o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.0000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0,2300
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.0000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0,2300
1	BTU0300144	60805000	CL	BTU	2044-01-01	1	NA	0	500.0000	UF	0,7600	1	365	RC	21.315	UF	CL	0,00	0,00	0,2300
1	BTU0300338	60805000	CL	BTU	2038-03-01	1	NA	0	500.0000	UF	0,7100	1	365	RC	19.815	UF	CL	0,00	0,00	0,2140
1	BTU0451023	60805000	CL	BTU	2023-10-15	1	NA	0	1.000.0000	UF	-0,2600	1	365	RC	33.715	UF	CL	0,00	0,00	0,3640
1	BVIAS-A	96814430	CL	BE	2030-10-30	1	AA	109	2.000.0000	UF	1,8400	1	365	RC	58.500	UF	CL	0,00	0,00	0,6310
1	BVIAS-A	96814430	CL	BE	2030-10-30	1	AA	109	500.0000	UF	1,8400	1	365	RC	14.628	UF	CL	0,00	0,00	0,1583
1	FNIA-100220	97023000	CL	DFP	2020-02-10	1	N-1	76	50.000.000.0000	\$\$	0,1800	1	30	NL	49.877	\$\$	CL	0,00	0,00	0,5380
1	UCH-F1108	97004000	CL	BU	2033-11-01	1	AA	3	2.000.0000	UF	1,4800	1	365	RC	78.041	UF	CL	0,00	0,00	0,8420
1	UCH-F1108	97004000	CL	BU	2033-11-01	1	AA	3	3.000.0000	UF	1,4800	1	365	RC	117.061	UF	CL	0,00	0,00	1,2630
1	UCORB0710	97023000	CL	BU	2035-07-01	1	AA	76	1.000.0000	UF	1,8700	1	365	RC	36.989	UF	CL	0,00	0,00	0,3990
1	UCORB0710	97023000	CL	BU	2035-07-01	1	AA	76	1.000.0000	UF	1,8700	1	365	RC	36.980	UF	CL	0,00	0,00	0,3988
<b>TOTAL</b>															<b>9.228.116</b>			<b>TOTAL</b>		<b>99,5311</b>

Al 31 de diciembre de 2018

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TIR valor por o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BBBVJ51113	97.032.000-8	CL	BB	01/05/2019	1	AAA	32	500,00	UF	3,0800	1	365	NC	13.849	\$\$	CL	-	-	0,2080
1	BBBVJ51113	97.032.000-8	CL	BB	01/05/2019	1	AAA	32	500,00	UF	3,0800	1	365	NC	13.849	\$\$	CL	-	-	0,2080
1	BBBVJ51113	97.032.000-8	CL	BB	01/05/2019	1	AAA	32	2.500,00	UF	3,0800	1	365	NC	69.243	\$\$	CL	-	-	1,0420
1	BBBV/M31113	97.032.000-8	CL	BB	01/11/2019	1	AAA	32	1.500,00	UF	1,7400	1	365	NC	41.978	\$\$	CL	-	-	0,6320
1	BBBV/M31113	97.032.000-8	CL	BB	01/11/2019	1	AAA	32	500,00	UF	1,7400	1	365	NC	13.993	\$\$	CL	-	-	0,2110
1	BBBV/M41113	97.032.000-8	CL	BB	01/05/2020	1	AAA	32	500,00	UF	1,6300	1	365	NC	14.097	\$\$	CL	-	-	0,2120
1	BBBV/M41113	97.032.000-8	CL	BB	01/05/2020	1	AAA	32	1.500,00	UF	1,6300	1	365	NC	42.290	\$\$	CL	-	-	0,6360
1	BBCAK1114	97.006.000-6	CL	BB	01/11/2019	1	AAA	13	125.000.000,00	\$\$	3,7600	1	365	NC	126.093	\$\$	CL	-	-	1,8980
1	BBNS-L0511	97.018.000-1	CL	BB	01/05/2021	1	AAA	32	1.000,00	UF	1,7600	1	365	NC	29.024	\$\$	CL	-	-	0,4370
1	BBNS-L0511	97.018.000-1	CL	BB	01/05/2021	1	AAA	32	2.000,00	UF	1,7600	1	365	NC	58.047	\$\$	CL	-	-	0,8740
1	BBNSAK0118	97.018.000-1	CL	BB	01/07/2023	1	AAA	32	3.000,00	UF	1,8700	1	365	NC	84.412	\$\$	CL	-	-	1,2700
1	BCALIA	96.511.530-7	CL	BB	15/06/2030	1	A	24	1.500,00	UF	3,2700	1	365	NC	45.447	\$\$	CL	-	-	0,6840
1	BCORA0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2020	1	AA	76	500,00	UF	1,7700	1	365	NC	14.240	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BCORA0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2020	1	AA	76	2.000,00	UF	1,7700	1	365	NC	56.962	\$\$	CL	-	-	0,8570
1	BCORAK0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2022	1	AA	76	500,00	UF	1,8100	1	365	NC	14.547	\$\$	CL	-	-	0,2190
1	BCORAK0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2022	1	AA	76	1.500,00	UF	1,8100	1	365	NC	43.641	\$\$	CL	-	-	0,6570
1	BCORAN0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2025	1	AA	76	1.500,00	UF	1,9500	1	365	NC	44.627	\$\$	CL	-	-	0,6720
1	BCORAN0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2025	1	AA	76	500,00	UF	1,9500	1	365	NC	14.876	\$\$	CL	-	-	0,2240
1	BCORAN0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2025	1	AA	76	500,00	UF	1,9500	1	365	NC	14.876	\$\$	CL	-	-	0,2240
1	BCORAN0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2025	1	AA	76	500,00	UF	1,9500	1	365	NC	14.876	\$\$	CL	-	-	0,2240
1	BCORA0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2026	1	AA	76	1.000,00	UF	2,0200	1	365	NC	29.869	\$\$	CL	-	-	0,4500
1	BCORA0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2026	1	AA	76	1.000,00	UF	2,0200	1	365	NC	29.869	\$\$	CL	-	-	0,4500
1	BCORA0710	97.023.000-9	CL	BB	01/07/2026	1	AA	76	2.000,00	UF	2,0200	1	365	NC	59.738	\$\$	CL	-	-	0,8990
1	BITAAG0614	97.023.000-9	CL	BB	01/06/2024	1	AA	76	2.000,00	UF	1,8700	1	365	NC	59.832	\$\$	CL	-	-	0,9000
1	BSTD040216	97.036.000-K	CL	BB	01/08/2021	1	AAA	14	3.000,00	UF	1,7000	1	365	NC	84.867	\$\$	CL	-	-	1,2770
1	BSTDEC0913	97.036.000-K	CL	BB	01/09/2023	1	AAA	14	4.000,00	UF	1,8100	1	365	NC	119.881	\$\$	CL	-	-	1,8040
1	BSTDP50315	97.036.000-K	CL	BB	01/03/2022	1	AAA	14	50.000.000,00	\$\$	4,3500	1	365	NC	52.339	\$\$	CL	-	-	0,7880
1	BSTDR10915	97.036.000-K	CL	BB	01/03/2021	1	AAA	14	4.000,00	UF	1,7900	1	365	NC	112.854	\$\$	CL	-	-	1,6980
1	BSTDR10915	97.036.000-K	CL	BB	01/03/2021	1	AAA	14	1.000,00	UF	1,7900	1	365	NC	28.213	\$\$	CL	-	-	0,4250
1	BSTDR10915	97.036.000-K	CL	BB	01/03/2021	1	AAA	14	1.000,00	UF	1,7900	1	365	NC	28.213	\$\$	CL	-	-	0,4250
1	BSTDR51215	97.036.000-K	CL	BB	01/12/2022	1	AAA	14	2.000,00	UF	1,7700	1	365	NC	56.882	\$\$	CL	-	-	0,8560
1	BSTDR51215	97.036.000-K	CL	BB	01/12/2022	1	AAA	14	1.000,00	UF	1,7700	1	365	NC	28.441	\$\$	CL	-	-	0,4280
1	BSTDSD0614	97.036.000-K	CL	BB	01/06/2019	1	AAA	14	10.000.000,00	\$\$	3,4900	1	365	NC	10.129	\$\$	CL	-	-	0,1520

Al 31 de diciembre de 2018

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TIR valor por o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BSTDS0614	97.036.000-K	CL	BB	01/06/2019	1	AAA	14	20.000.000,00	\$\$	3.4900	1	365	NC	20.258	\$\$	CL	-	-	0,3050
1	BSTDS0614	97.036.000-K	CL	BB	01/06/2019	1	AAA	14	50.000.000,00	\$\$	3.4900	1	365	NC	50.645	\$\$	CL	-	-	0,7620
1	BCP0400119	97.029.000-1	CL	BCP	01/01/2019	1	NA	0	30.000.000,00	\$\$	2.9800	1	365	NC	30.598	\$\$	CL	-	-	0,4600
1	BCP0400119	97.029.000-1	CL	BCP	01/01/2019	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	2.9800	1	365	NC	5.100	\$\$	CL	-	-	0,0770
1	BCP0400119	97.029.000-1	CL	BCP	01/01/2019	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	2.9800	1	365	NC	5.100	\$\$	CL	-	-	0,0770
1	BCP0450620	97.029.000-1	CL	BCP	01/06/2020	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5000	1	365	NC	5.089	\$\$	CL	-	-	0,0770
1	BCP0450620	97.029.000-1	CL	BCP	01/06/2020	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5000	1	365	NC	5.089	\$\$	CL	-	-	0,0770
1	BCP0450620	97.029.000-1	CL	BCP	01/06/2020	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5000	1	365	NC	5.089	\$\$	CL	-	-	0,0770
1	BCP0450620	97.029.000-1	CL	BCP	01/06/2020	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5000	1	365	NC	5.089	\$\$	CL	-	-	0,0770
1	BCP0450620	97.029.000-1	CL	BCP	01/06/2020	1	NA	0	50.000.000,00	\$\$	3.5000	1	365	NC	50.886	\$\$	CL	-	-	0,7660
1	BCP0450620	97.029.000-1	CL	BCP	01/06/2020	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5000	1	365	NC	5.089	\$\$	CL	-	-	0,0770
1	BCU0300221	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2021	1	NA	0	500,00	UF	1,1500	1	365	NC	14,478	\$\$	CL	-	-	0,2180
1	BCU0300221	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2021	1	NA	0	2.500,00	UF	1,1500	1	365	NC	72,390	\$\$	CL	-	-	1,0890
1	BCU0300221	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2021	1	NA	0	500,00	UF	1,1500	1	365	NC	14,478	\$\$	CL	-	-	0,2180
1	BCU0300221	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2021	1	NA	0	500,00	UF	1,1500	1	365	NC	14,478	\$\$	CL	-	-	0,2180
1	BCU0300231	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2031	1	NA	0	1.000,00	UF	1,6300	1	365	NC	32,054	\$\$	CL	-	-	0,4820
1	BCU0300231	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2031	1	NA	0	500,00	UF	1,6300	1	365	NC	16,027	\$\$	CL	-	-	0,2410
1	BCU0300231	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2031	1	NA	0	1.000,00	UF	1,6300	1	365	NC	32,054	\$\$	CL	-	-	0,4820
1	BCU0300241	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2041	1	NA	0	500,00	UF	1,9000	1	365	NC	16,698	\$\$	CL	-	-	0,2510
1	BCU0300241	97.029.000-1	CL	BCU	01/02/2041	1	NA	0	1.500,00	UF	1,9000	1	365	NC	50,095	\$\$	CL	-	-	0,7540
1	BCU0300322	97.029.000-1	CL	BCU	01/03/2022	1	NA	0	500,00	UF	1,2100	1	365	NC	14,687	\$\$	CL	-	-	0,2210
1	BCU0300322	97.029.000-1	CL	BCU	01/03/2022	1	NA	0	1.500,00	UF	1,2100	1	365	NC	44,060	\$\$	CL	-	-	0,6630
1	BAMOV-D	59.123.340-8	CL	BE	25/05/2035	1	AA+	0	1.000,00	UF	2,6300	1	365	NC	32,598	\$\$	CL	-	-	0,4910
1	BARAU-F	93.458.000-1	CL	BE	30/10/2029	1	AA-	1	500,00	UF	2,0200	1	365	NC	15,444	\$\$	CL	-	-	0,2320
1	BARAU-F	93.458.000-1	CL	BE	30/10/2029	1	AA-	1	500,00	UF	2,0200	1	365	NC	15,444	\$\$	CL	-	-	0,2320
1	BARAU-F	93.458.000-1	CL	BE	30/10/2029	1	AA-	1	500,00	UF	2,0200	1	365	NC	15,444	\$\$	CL	-	-	0,2320
1	BARAU-P	93.458.000-1	CL	BE	15/11/2032	1	AA-	1	1.000,00	UF	2,1800	1	365	NC	31,522	\$\$	CL	-	-	0,4740
1	BARAU-P	93.458.000-1	CL	BE	15/11/2032	1	AA-	1	500,00	UF	2,1800	1	365	NC	15,761	\$\$	CL	-	-	0,2370
1	BARAU-R	93.458.000-1	CL	BE	01/04/2035	1	AA-	1	1.000,00	UF	2,5100	1	30	NA	31,739	\$\$	CL	-	-	0,4780
1	BARAU-R	93.458.000-1	CL	BE	01/04/2035	1	AA-	1	500,00	UF	2,5100	1	30	NA	15,870	\$\$	CL	-	-	0,2390
1	BAYS3-A	76.038.659-6	CL	BE	15/12/2032	1	AA-	153	1.000,00	UF	2,1600	1	30	NA	32,549	\$\$	CL	-	-	0,4900
1	BCLEA	76.187.228-1	CL	BE	22/08/2047	1	A+	165	1.000,00	UF	2,6000	1	30	NA	29,494	\$\$	CL	-	-	0,4440
1	BCGEH	76.411.321-7	CL	BE	11/08/2029	1	AA-	18	1.000,00	UF	2,3000	1	30	NA	32,594	\$\$	CL	-	-	0,4910

Al 31 de diciembre de 2018

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TIR valor por precio	Código de valuación	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BCMFC-F	96.596.540-8	CL	BE	24/03/2030	1	AA-	2	1.500,00	UF	2.3500	1	365	NC	49.613	\$\$	CL	-	-	0,7470
1	BCMFC-F	96.596.540-8	CL	BE	24/03/2030	1	AA-	2	500,00	UF	2.3500	1	365	NC	16.538	\$\$	CL	-	-	0,2490
1	BCODE-B	61.704.000-K	CL	BE	01/04/2025	1	AAA	21	1.000,00	UF	1.8600	1	365	NC	31.319	\$\$	CL	-	-	0,4710
1	BCODE-B	61.704.000-K	CL	BE	01/04/2025	1	AAA	21	1.000,00	UF	1.8600	1	365	NC	31.319	\$\$	CL	-	-	0,4710
1	BCODE-C	61.704.000-K	CL	BE	24/08/2026	1	AAA	21	2.000,00	UF	1.9500	1	365	NC	57.733	\$\$	CL	-	-	0,8690
1	BCORAR0710	76.645.030-K	CL	BE	01/07/2029	1	AA	76	2.500,00	UF	2.1700	1	365	NC	75.364	\$\$	CL	-	-	1,1340
1	BCOTA-B	96.813.520-1	CL	BE	30/10/2030	1	A+	22	1.500,00	UF	2.3200	1	365	NC	49.725	\$\$	CL	-	-	0,7480
1	BEOP-C	90.690.000-9	CL	BE	30/11/2030	1	AA-	1	2.000,00	UF	2.3000	1	365	NC	66.298	\$\$	CL	-	-	0,9980
1	BEIAP-B	92.604.000-6	CL	BE	12/01/2019	1	AAA	21	1.000,00	UF	3.8700	1	365	NC	28.150	\$\$	CL	-	-	0,4240
1	BEIAP-B	92.604.000-6	CL	BE	12/01/2019	1	AAA	21	2.000,00	UF	3.8700	1	365	NC	56.299	\$\$	CL	-	-	0,8470
1	BEINDE-M	91.081.000-6	CL	BE	15/12/2029	1	AA	15	2.000,00	UF	1.9300	1	365	NC	63.337	\$\$	CL	-	-	0,9530
1	BEINTE-M	92.580.000-7	CL	BE	30/05/2036	1	A+	27	500,00	UF	2.9900	1	365	NC	14.715	\$\$	CL	-	-	0,2210
1	BEINTE-M	92.580.000-7	CL	BE	30/05/2036	1	A+	27	1.500,00	UF	2.9900	1	365	NC	44.144	\$\$	CL	-	-	0,6640
1	BESSB-D	76.833.300-9	CL	BE	15/11/2029	1	AA	75	1.000,00	UF	2.3600	1	365	NC	31.041	\$\$	CL	-	-	0,4670
1	BLQIF-D	96.929.880-5	CL	BE	15/05/2033	1	AA+	3	1.000,00	UF	2.2100	1	365	NC	30.967	\$\$	CL	-	-	0,4660
1	BNTRA-D	76.555.400-4	CL	BE	15/12/2027	1	AA-	187	1.000,00	UF	2.4200	1	365	NC	31.590	\$\$	CL	-	-	0,4750
1	BNTRA-D	76.555.400-4	CL	BE	15/12/2027	1	AA-	187	2.000,00	UF	2.4200	1	365	NC	63.180	\$\$	CL	-	-	0,9510
1	BNTRA-D	76.555.400-4	CL	BE	15/12/2027	1	AA-	187	1.000,00	UF	2.4200	1	365	NC	31.590	\$\$	CL	-	-	0,4750
1	BSWTR-E	76.023.436-4	CL	BE	08/09/2034	1	A+	75	1.000,00	UF	2.5800	1	365	NC	34.944	\$\$	CL	-	-	0,5260
1	BSWTR-I	76.023.436-4	CL	BE	08/09/2036	1	A+	75	1.000,00	UF	2.6800	1	365	NC	34.702	\$\$	CL	-	-	0,5220
1	BTR0400323	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2023	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.9600	1	365	NC	5.081	\$\$	CL	-	-	0,0760
1	BTR0400323	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2023	1	NA	0	40.000.000,00	\$\$	3.9600	1	365	NC	40.650	\$\$	CL	-	-	0,6120
1	BTR0400323	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2023	1	NA	0	25.000.000,00	\$\$	3.9600	1	365	NC	25.406	\$\$	CL	-	-	0,3820
1	BTR0450221	60.805.000-0	CL	BTP	28/02/2021	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5600	1	365	NC	5.175	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTR0450221	60.805.000-0	CL	BTP	28/02/2021	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5600	1	365	NC	5.175	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTR0450221	60.805.000-0	CL	BTP	28/02/2021	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5600	1	365	NC	5.175	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTR0450221	60.805.000-0	CL	BTP	28/02/2021	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5600	1	365	NC	5.175	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTR0450221	60.805.000-0	CL	BTP	28/02/2021	1	NA	0	50.000.000,00	\$\$	3.5600	1	30	NA	51.754	\$\$	CL	-	-	0,7790
1	BTR0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	NA	0	140.000.000,00	\$\$	3.5700	1	30	NA	144.878	\$\$	CL	-	-	2,1800
1	BTR0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	3.5700	1	30	NA	10.348	\$\$	CL	-	-	0,1560
1	BTR0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	3.5700	1	30	NA	5.174	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTR0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	3.5700	1	30	NA	10.348	\$\$	CL	-	-	0,1560

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENTA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**Al 31 de diciembre de 2018**

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TR valor por o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BTP0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	AA-	0	5.000.000,00	UF	3.5700	1	365	NC	5.174	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	AA-	0	5.000.000,00	UF	3.5700	1	365	NC	5.174	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	AAA	0	5.000.000,00	UF	3.5700	1	365	NC	5.174	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	AAA	0	10.000.000,00	UF	3.5700	1	365	NC	10.348	\$\$	CL	-	-	0,1560
1	BTP0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	AAA	0	10.000.000,00	UF	3.5700	1	365	NC	10.348	\$\$	CL	-	-	0,1560
1	BTP0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	AA	0	10.000.000,00	UF	3.5700	1	365	NC	10.348	\$\$	CL	-	-	0,1560
1	BTP0450321	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2021	1	A+	0	5.000.000,00	UF	3.5700	1	365	NC	5.174	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	AA-	0	10.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	10.352	\$\$	CL	-	-	0,1560
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	AAA	0	20.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	20.705	\$\$	CL	-	-	0,3120
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	AAA	0	10.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	10.352	\$\$	CL	-	-	0,1560
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	AA	0	5.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	5.176	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	A+	0	15.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	15.529	\$\$	CL	-	-	0,2340
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	A+	0	10.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	10.352	\$\$	CL	-	-	0,1560
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	AA	0	5.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	5.176	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	AA+	0	5.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	5.176	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	AA-	0	5.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	5.176	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	AA-	0	5.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	5.176	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	A+	0	5.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	5.176	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	A+	0	5.000.000,00	UF	4.2100	1	365	NC	5.176	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0450326	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2026	1	NA	0	200.000.000,00	\$\$	4.2100	1	365	NC	207.049	\$\$	CL	-	-	3,1160
1	BTP0470930	60.805.000-0	CL	BTP	01/09/2030	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	4.4500	1	365	NC	10.423	\$\$	CL	-	-	0,1570
1	BTP0470930	60.805.000-0	CL	BTP	01/09/2030	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	4.4500	1	365	NC	5.212	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0470930	60.805.000-0	CL	BTP	01/09/2030	1	NA	0	40.000.000,00	\$\$	4.4500	1	365	NC	41.693	\$\$	CL	-	-	0,6270
1	BTP0470930	60.805.000-0	CL	BTP	01/09/2030	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	4.4500	1	365	NC	5.212	\$\$	CL	-	-	0,0780
1	BTP0470930	60.805.000-0	CL	BTP	01/09/2030	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	4.4500	1	365	NC	10.423	\$\$	CL	-	-	0,1570
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	4.6400	1	365	NC	5.315	\$\$	CL	-	-	0,0800
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	4.6400	1	365	NC	10.630	\$\$	CL	-	-	0,1600
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	4.6400	1	30	NA	5.315	\$\$	CL	-	-	0,0800
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	4.6400	1	30	NA	10.630	\$\$	CL	-	-	0,1600
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	0	20.000.000,00	\$\$	4.6400	1	30	NA	21.261	\$\$	CL	-	-	0,3200
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	4.6400	1	30	NA	10.630	\$\$	CL	-	-	0,1600
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	4.6400	1	30	NA	10.630	\$\$	CL	-	-	0,1600

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**Al 31 de diciembre de 2018**

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TR valor por o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	2	10.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	10.630	\$\$	CL	-	-	0,1600
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	2	5.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	5.315	\$\$	CL	-	-	0,0800
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	21	5.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	5.315	\$\$	CL	-	-	0,0800
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	21	10.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	10.630	\$\$	CL	-	-	0,1600
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	21	5.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	5.315	\$\$	CL	-	-	0,0800
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	76	5.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	5.315	\$\$	CL	-	-	0,0800
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	22	20.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	21.261	\$\$	CL	-	-	0,3200
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	1	50.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	53.152	\$\$	CL	-	-	0,8000
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	21	5.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	5.315	\$\$	CL	-	-	0,0800
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	21	10.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	10.630	\$\$	CL	-	-	0,1600
1	BTP0500335	60.805.000-0	CL	BTP	01/03/2035	1	NA	15	110.000.000,00	\$\$	4,6400	1	365	NC	116.935	\$\$	CL	-	-	1,7600
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	27	55.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	66.625	\$\$	CL	-	-	1,0030
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	27	5.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	6.057	\$\$	CL	-	-	0,0910
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	75	5.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	6.057	\$\$	CL	-	-	0,0910
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	3	25.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	30.284	\$\$	CL	-	-	0,4560
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	187	5.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	6.057	\$\$	CL	-	-	0,0910
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	187	5.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	6.057	\$\$	CL	-	-	0,0910
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	187	10.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	12.114	\$\$	CL	-	-	0,1820
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	75	20.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	24.227	\$\$	CL	-	-	0,3650
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	75	20.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	24.227	\$\$	CL	-	-	0,3650
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	0	30.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	36.341	\$\$	CL	-	-	0,5470
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	6.057	\$\$	CL	-	-	0,0910
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	6.057	\$\$	CL	-	-	0,0910
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	0	10.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	12.114	\$\$	CL	-	-	0,1820
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	6.057	\$\$	CL	-	-	0,0910
1	BTP0600143	60.805.000-0	CL	BTP	01/01/2043	1	NA	0	5.000.000,00	\$\$	4,7800	1	365	NC	6.057	\$\$	CL	-	-	0,0910
1	BTU0130323	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2023	1	NA	0	2.000,00	UF	1,2400	1	365	NC	55.513	\$\$	CL	-	-	0,8350
1	BTU0150321	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2021	1	NA	0	500,00	UF	1,1400	1	365	NC	13.958	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150321	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2021	1	NA	0	500,00	UF	1,1400	1	30	NA	13.958	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150321	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2021	1	NA	0	1.000,00	UF	1,1400	1	30	NA	27.916	\$\$	CL	-	-	0,4200
1	BTU0150321	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2021	1	NA	0	500,00	UF	1,1400	1	30	NA	13.958	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150321	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2021	1	NA	0	500,00	UF	1,1400	1	30	NA	13.958	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150321	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2021	1	NA	0	1.000,00	UF	1,1400	1	30	NA	27.916	\$\$	CL	-	-	0,4200

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**Al 31 de diciembre de 2018**

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TR valor par o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BTU0150321	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2021	1	AA-	2	6.500,00	UF	1,1400	1	365	NC	181.453	\$\$	CL	-	-	2,7310
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AA-	2	10.000,00	UF	1,4200	1	365	NC	278.605	\$\$	CL	-	-	4,1930
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AAA	21	500,00	UF	1,4200	1	365	NC	13.930	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AAA	21	500,00	UF	1,4200	1	365	NC	13.930	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AAA	21	500,00	UF	1,4200	1	365	NC	13.930	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AA	76	500,00	UF	1,4200	1	365	NC	13.930	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	A+	22	500,00	UF	1,4200	1	365	NC	13.930	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AA-	1	500,00	UF	1,4200	1	365	NC	13.930	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AAA	21	500,00	UF	1,4200	1	365	NC	13.930	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AAA	21	1.000,00	UF	1,4200	1	365	NC	27.860	\$\$	CL	-	-	0,4190
1	BTU0150326	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2026	1	AA	15	500,00	UF	1,4200	1	365	NC	13.930	\$\$	CL	-	-	0,2100
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	A+	27	500,00	UF	1,8200	1	365	NC	14.235	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	A+	27	2.000,00	UF	1,8200	1	365	NC	56.939	\$\$	CL	-	-	0,8570
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	AA	75	5.000,00	UF	1,8200	1	365	NC	142.348	\$\$	CL	-	-	2,1420
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	AA+	3	500,00	UF	1,8200	1	365	NC	14.235	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	AA-	187	500,00	UF	1,8200	1	365	NC	14.235	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	AA-	187	500,00	UF	1,8200	1	365	NC	14.235	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	AA-	187	500,00	UF	1,8200	1	365	NC	14.235	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	A+	75	500,00	UF	1,8200	1	365	NC	14.235	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	A+	75	500,00	UF	1,8200	1	365	NC	14.235	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	NA	0	1.000,00	\$\$	1,8200	1	365	NC	28.470	\$\$	CL	-	-	0,4280
1	BTU0200335	60.805.000-0	CL	BTU	01/03/2035	1	NA	0	500,00	\$\$	1,8200	1	365	NC	14.235	\$\$	CL	-	-	0,2140
1	BTU0300140	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2040	1	NA	0	1.500,00	\$\$	1,9000	1	365	NC	49.873	\$\$	CL	-	-	0,7510
1	BTU0300140	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2040	1	NA	0	500,00	\$\$	1,9000	1	365	NC	16.624	\$\$	CL	-	-	0,2500
1	BTU0300142	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2042	1	NA	0	500,00	\$\$	1,9300	1	365	NC	16.741	\$\$	CL	-	-	0,2520
1	BTU0300142	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2042	1	NA	0	500,00	\$\$	1,9300	1	365	NC	16.741	\$\$	CL	-	-	0,2520
1	BTU0300142	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2042	1	NA	0	1.000,00	\$\$	1,9300	1	365	NC	33.481	\$\$	CL	-	-	0,5040
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	NA	0	500,00	\$\$	1,9400	1	365	NC	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	NA	0	500,00	\$\$	1,9400	1	30	NA	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	NA	0	500,00	\$\$	1,9400	1	30	NA	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	NA	0	500,00	\$\$	1,9400	1	30	NA	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	NA	0	500,00	\$\$	1,9400	1	30	NA	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540

**FONDO DE INVERSIÓN ZURICH  
RENDA FIJA CHILE INDEX FUND**

Estados Complementarios a los Estados Financieros

**Al 31 de diciembre de 2018**

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de instrumento	Fecha de vencimiento	Situación del instrumento	Clasificación de riesgo	Grupo empresarial	Cantidad de unidades	Tipo de unidades	TIR valor por o precio	Código de valorización	Base tasa	Tipo de interés	Valorización al cierre	Código moneda de liquidación	Código país de transacción	del capital del emisor	del activo del emisor	del activo del fondo
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	AA-	2	500,00	UF	1,9400	1	365	NC	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	AA-	2	500,00	UF	1,9400	1	365	NC	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	AAA	21	1.000,00	UF	1,9400	1	365	NC	33.794	\$\$	CL	-	-	0,5090
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	AAA	21	500,00	UF	1,9400	1	365	NC	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	AAA	21	5.000,00	UF	1,9400	1	365	NC	168.972	\$\$	CL	-	-	2,5430
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	AA	76	500,00	UF	1,9400	1	365	NC	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	A+	22	1.000,00	UF	1,9400	1	365	NC	33.794	\$\$	CL	-	-	0,5090
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BTU	01/01/2044	1	AA-	1	500,00	UF	1,9400	1	365	NC	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	BTU0300144	60.805.000-0	CL	BU	01/11/2033	1	AAA	21	500,00	UF	1,9400	1	365	NC	16.897	\$\$	CL	-	-	0,2540
1	UCH#F1108	97.004.000-5	CL	BU	01/07/2035	1	AAA	21	6.000,00	UF	2,3700	1	365	NC	209.727	\$\$	CL	-	-	3,1560
1	UCORBI0710	97.023.000-9	CL	CFI		1	AA	15	1.000,00	UF	2,4200	1	365	NC	34.068	\$\$	CL	-	-	0,5130
1	FNBCI-030119	97.006.000-6	CL	DPC	15/01/2019	1	A+	27	13.685.591,00	UF	0,2300	1	365	NC	13.682	\$\$	CL	-	-	0,2060
1	FNBS-150119	97.018.000-1	CL	DPC	14/01/2019	1	AA	75	50.225.000,00	UF	0,2500	1	365	NC	50.162	\$\$	CL	-	-	0,7550
1	FNCH#-140119	97.004.000-5	CL	DPC	11/02/2019	1	AA+	3	30.000.000,00	UF	0,2300	1	365	NC	29.968	\$\$	CL	-	-	0,4510
1	FNST-110219	97.030.000-7	CL	DPC	17/01/2019	1	AA-	187	10.000.000,00	UF	0,2500	1	365	NC	9.965	\$\$	CL	-	-	0,1500
1	FNITA-170119	76.645.030-K	CL	DPC	14/01/2019	1	AA-	187	26.080.000,00	UF	0,2400	1	365	NC	26.045	\$\$	CL	-	-	0,3920
1	FNSEC-140119	97.053.000-2	CL	DPC	07/01/2019	1	AA-	187	50.000.000,00	UF	0,2400	1	365	NC	49.944	\$\$	CL	-	-	0,7520
1	FNSTD-070119	97.036.000-K	CL	FDBC	03/01/2019	1	A+	75	45.943.631,00	UF	0,2300	1	365	NC	45.927	\$\$	CL	-	-	0,6910
1	BNPDBO30119	97.029.000-1	CL	BTU	01/03/2035	1	A+	75	60.000.000,00	UF	0,2000	1	365	NC	59.988	\$\$	CL	-	-	0,9030