

DESCRIPCIÓN DE LA ESTRATEGIA

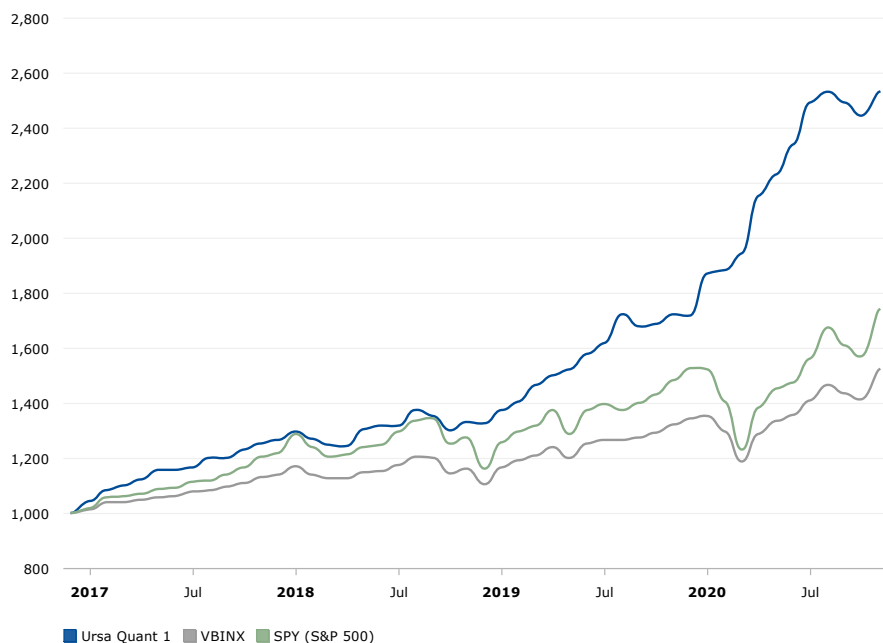
La estrategia es comandada por algoritmos matemáticos construidos en base al análisis cuantitativo de diferentes mercados, permitiendo capturar patrones de comportamiento en diversos escenarios económicos.

Ursa Quant 1 consiste en un portafolio de instrumentos completamente reactivo que se va adaptando a las condiciones vigentes, con excelentes resultados. La selección de los activos se realiza dentro de un universo previamente definido y acotado que cumple con rigurosos criterios de liquidez, volatilidad, clasificación de riesgo y correlaciones entre ellos.

El portafolio cuenta con mecanismos de protección de monitoreo diario que permiten detectar condiciones de mercado adversas y refugiarse en activos defensivos y de cobertura para disminuir la exposición al riesgo o incertidumbre. Adicionalmente, hace un rebalanceo periódico de sus posiciones para mantener una estructura equilibrada entre las distintas clases de activos y cumplir con los criterios de paridad de riesgo.

Este tipo de inversión cuantitativa se considera como inversión alternativa con riesgo moderado. Permite diversificar las carteras de inversión dada su baja correlación con los instrumentos tradicionales.

EVOLUCIÓN DE UNA INVERSIÓN INICIAL DE 1.000



ESTADÍSTICAS PRINCIPALES

CAGR	26.77%	Retorno 12 meses	47.09%
Año a la fecha	47.31%	Drawdown Max	-5.41%

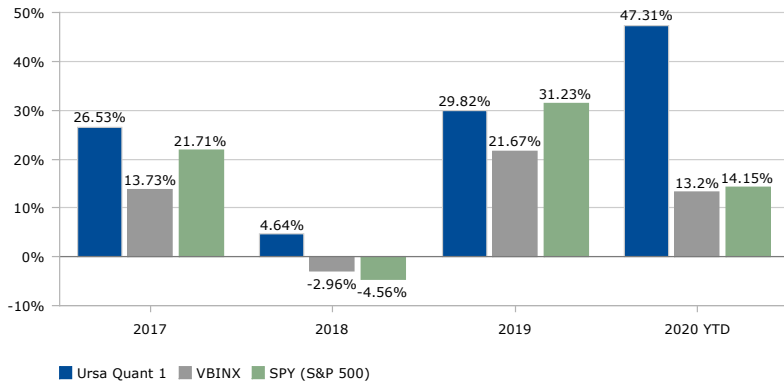
OTRAS ESTADÍSTICAS

Correlación vs. VBINX	0.52
Desviación Estándar Mensual	2.83%
Alfa	1.57
Beta	0.50
Ratio de Sharpe	2.49
Ratio de Sortino	7.67
Kurtosis	1.22
% Meses Ganadores	74.47%
Promedio Meses Ganadores	3.21%
Promedio Meses Perdedores	-1.39%
Desviación a la Baja	0.90

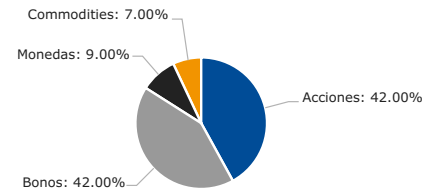
RENTABILIDAD MENSUAL (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Anual
2020	8.68	0.86	3.15	10.65	3.80	4.85	6.44	1.61	-1.61	-1.86	3.59		47.31
2019	3.61	2.22	4.40	2.43	1.45	3.68	2.48	6.61	-2.71	0.52	2.14	-0.15	29.82
2018	2.24	-2.01	-1.67	-0.26	4.84	1.10	-0.09	4.50	-1.61	-3.87	2.28	-0.51	4.64
2017	4.14	4.04	1.37	2.23	2.88	0.01	1.03	2.96	-0.30	2.68	1.86	0.95	26.53

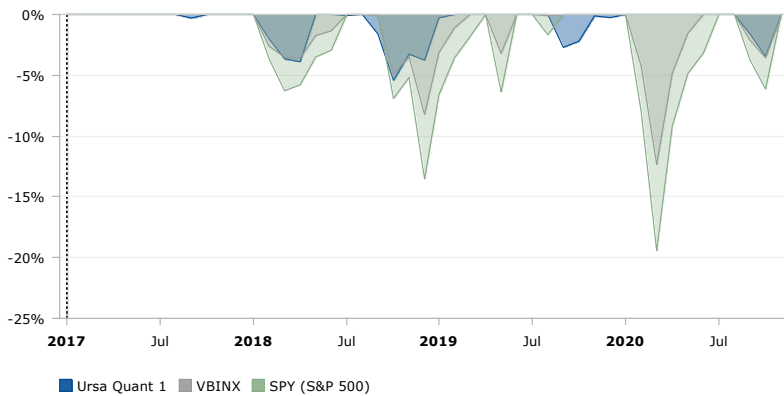
RENTABILIDAD ANUAL



CLASES DE ACTIVOS



DRAWDOWNS



PEORES PERÍODOS

Período	1 Mes	3 Meses	6 Meses	1 Año	2 Años
1	-3.87	-3.90	0.48	4.64	29.43
2	-2.71	-3.26	1.04	5.75	31.69
3	-2.01	-2.19	1.77	6.05	31.73
4	-1.86	-1.88	1.94	6.18	32.40
5	-1.67	-1.49	2.11	10.63	33.29
6	-1.61	-1.16	3.99	10.71	33.55
7	-1.61	-0.11	4.02	12.78	35.85
8	-0.51	0.03	4.14	12.82	36.52
9	-0.30	1.14	4.21	12.96	36.98
10	-0.26	2.51	4.67	13.48	37.35

VENTANA DE TIEMPO

	3 Meses	6 Meses	1 Año	2 Años	3 Años
Retorno Promedio	0.11%	28.69%	47.09%	37.93%	26.42%
Meses Positivos	33.33%	66.67%	75.00%	79.17%	69.44%
Promedio Período Positivo	3.59%	4.13%	4.85%	3.85%	3.56%
Promedio Período Negativo	-1.74%	-1.74%	-1.21%	-1.37%	-1.49%
Ratio de Sharpe	0.06	2.41	3.10	3.04	2.23
Ratio de Sortino	0.02	7.33	15.91	12.47	6.64
Desviación Estándar	2.51%	3.12%	3.73%	3.15%	3.14%

SOBRE URSA

Empresa chilena que desarrolla, implementa y opera sistemas inteligentes de inversión en base a algoritmos cuantitativos. Con más de 20 años de experiencia entre sus socios, Ursa Group desarrolla soluciones autónomas de alta complejidad que toman decisiones de inversión excepcionales.

INFORMACIÓN GENERAL

Compañía	Ursa Group SpA
Dirección	La Dehesa 181, oficina 208 Lo Barnechea
Portfolio Manager	Nicolás Cottin