

FONDO DE INVERSIÓN SECURITY HY CHILE
Notas a los estados financieros al 30 de septiembre de 2017

II. CARTERAS DE INVERSIÓN, continuación

1) INVERSIONES EN VALORES O INSTRUMENTOS EMITIDOS POR EMISORES NACIONALES, continuación

Al 30 de septiembre de 2017

Clasificación del instrumento en el Estado de Situación Financiera	Nemotécnico del Instrumento	RUT del emisor	Código país emisor	Tipo de inst.	Fecha de vencimiento	Situación del riesgo	Clasif. de riesgo	Grupo Emp.	Cantidad de unidades	Unidad de Valorización			Valor al cierre	Código moneda de	Código país	Porcentajes		
										TIR, valor par o precio	Código de valoriza	Base tasa interés				Tipo de interés	del capital del	del activo del
1	BREDS-C	76020458	CL	BE	2032-12-31	1	A	136	6.000.0000	UF	2,70	365	RC	182.364	CL	0,000%	0,000%	0,7909%
1	BRPLC-D	99579730	CL	BE	2021-10-15	1	A	33	3.000.0000	UF	1,97	365	RC	80.791	CL	0,000%	0,000%	0,3504%
1	BCIRS20103	97006000	CL	LH	2023-01-01	1	AA	13	1.210.0000	UF	3,01	360	RC	13.234	CL	0,000%	0,000%	0,0574%
1	BHER-M0117	70016330	CL	BE	2022-01-05	1	A		25.000.0000	UF	3,28	365	RC	686.336	CL	0,000%	0,000%	2,9768%
1	CH0360101	97004000	CL	LH	2021-01-01	1	AAA	3	330.0000	UF	3,11	360	RC	2.529	CL	0,000%	0,000%	0,0110%
1	EST0620100	97030000	CL	LH	2020-01-01	1	AAA	21	950.0000	UF	2,57	360	RC	5.679	CL	0,000%	0,000%	0,0246%
1	BBV-M50404	97032000	CL	LH	2019-04-01	1	AA	37	360.0000	UF	2,61	360	RC	1.685	CL	0,000%	0,000%	0,0073%
1	BCELE-A	76187228	CL	BE	2047-06-22	1	A	165	5.000.0000	UF	2,80	365	RC	143.489	CL	0,000%	0,000%	0,6223%
1	BGENE-N	94272000	CL	BE	2028-12-01	1	A	30	7.000.0000	UF	2,86	365	RC	201.124	CL	0,000%	0,000%	0,8723%
1	BSWTR-E	76023435	CL	BE	2034-09-08	1	A	75	2.000.0000	UF	2,91	365	RC	65.340	CL	0,000%	0,000%	0,2834%
1	DESSE560104	97018000	CL	LH	2019-01-01	1	AAA	32	450.0000	UF	3,15	360	RC	1.732	CL	0,000%	0,000%	0,0075%

TOTAL **1.384.303**
TOTAL CARTERA **16.914.061**

TOTAL **6,0040%**
TOTAL CARTERA **73,3595%**

2) INVERSIONES EN VALORES O INSTRUMENTOS EMITIDOS POR EMISORES EXTRANJEROS

Al 30 de septiembre de 2017, el Fondo presenta las siguientes inversiones en valores o instrumentos emitidos por emisores extranjeros:

Clasific. del instrum. en el Estado de Situación Financiera	Código ISIN o CUSIP	Nemotécnico del instrumento	Nombre del emisor	Código país emisor	Tipo de instr.	Fecha de venc.	Situac. del inst.	Clas. de riesgo	Nombre del grupo emp.	Cantidad de unidades	Tipo de uni.	Unidad de Valorización			Valor al cierre	Código moneda de liquid.	Código país de transac.	Porcentajes (1)		
												TIR, valor par o precio	Código de valoriz.	Base tasa interés				Tipo de interés	del capital del emisor	del activo del emisor
1	USA2866AA70	USA2866AA70	JBS S.A.	US	BEE	2020-10-28	1B			1.000.000,00	PROM	102,2949	1	360	RC	673.190	US	0,0000%	0,0000%	2,9198%
1	US71647NA580	US71647NA580	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV	NL	BEE	2027-01-17	1B			600.000,00	PROM	110,1700	1	360	RC	427.409	NL	0,0000%	0,0000%	1,8538%
1	USN0417JAB72	USN0417JAB72	VTR FINANCE BV	US	BEE	2024-01-15	1B			1.500.000,00	PROM	105,9425	1	360	RC	1.027.463	US	0,0000%	0,0000%	4,4563%
1	USP989UAJ76	USP989UAJ76	YPF S.A.	AR	BEE	2024-04-04	1B			300.000,00	PROM	115,0827	1	360	RC	228.631	AR	0,0000%	0,0000%	0,9907%
1	USG0740ZDP58	USG0740ZDP58	BRANCO DO BRASIL S.A.	BR	BBFE	2024-04-15	1B			500.000,00	PROM	88,9732	1	360	RC	282.850	US	0,0000%	0,0000%	1,2705%
1	USG25343AA52	USG25343AA52	COSAN LTD	BR	BBFE	2024-09-20	1BB			700.000,00	PROM	102,3471	1	360	RC	467.773	BR	0,0000%	0,0000%	1,9854%
1	USP989MJB147	USP989MJB147	YPF S.A.	AR	BEE	2027-07-21	1B			250.000,00	PROM	106,2904	1	360	RC	171.639	AR	0,0000%	0,0000%	0,7444%
1	US71647NAQ25	US71647NAQ25	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV	US	BEE	2026-05-23	1B			500.000,00	PROM	120,2585	1	360	RC	393.428	US	0,0000%	0,0000%	1,7084%
1	USCS327AA30	USCS327AA30	Genpark Ltd	BM	BEE	2026-09-21	1B			1.500.000,00	PROM	100,2341	1	360	RC	980.860	PROM	0,0000%	0,0000%	4,1687%
1	USL6401PAF01	USL6401PAF01	Minerva Luxembourg SA	LU	BEE	2026-09-20	1BB			500.000,00	PROM	101,0983	1	360	RC	323.038	US	0,0000%	0,0000%	1,4011%
1	USN64468AF52	USN64468AF52	MARFRIG HOLDING EUROPE B	US	BEE	2023-06-08	1B			500.000,00	PROM	103,6489	1	360	RC	338.542	PROM	0,0000%	0,0000%	1,4683%

TOTAL **5.294.533**
TOTAL **22,9634%**

FONDO DE INVERSIÓN SECURITY HY CHILE
Notas a los estados financieros al 30 de septiembre de 2017

II. CARTERAS DE INVERSIÓN, continuación

3) INVERSIONES VALORIZADAS SEGÚN EL MÉTODO DE LA PARTICIPACIÓN

Al 30 septiembre de 2017 y 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene inversiones valorizadas según el método de la participación.

4) INVERSIONES EN BIENES RAÍCES NACIONALES Y EXTRANJEROS

Al 30 septiembre de 2017 y 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene inversiones en bienes raíces nacionales o en el extranjero.

5) INVERSIONES EN CONTRATOS DE OPCIONES

Al 30 septiembre de 2017 y 31 de diciembre de 2016, el Fondo no tiene inversiones contratos de opciones.

6) INVERSIONES EN CONTRATOS DE FUTUROS Y FORWARDS

Al 30 septiembre de 2017, el Fondo no presenta inversiones en contratos de futuros y forwards como parte del activo del fondo y 31 de diciembre de 2016, el Fondo tiene inversiones en contratos de futuros y forwards como parte del activo del fondo que se detallan a continuación:

Al 30 de septiembre de 2017

INVERSIONES EN CONTRATOS DE FUTURO Y FORWARD													
Identificación del Instrumento													
Clasificación del instrumento o en el Estado de	Activo objeto	Nemotécnico del instrumento	Unidad de cotización	Fecha de inicio del contrato	Fecha de vencimiento	Nombre contraparte	Código moneda de liquidación	Código país	Posición compra/venta	Unidades nominales totales	Precio a futuro del contrato (1)	Monto comprometido (2)	Valorización de mercado del contrato (2)
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-06-22	2018-03-14	BANCO INTERNACIONAL	\$\$	CL	V	800.000	671.0500	536.840	24.253
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-07-03	2018-03-14	BANCO INTERNACIONAL	\$\$	CL	V	730.000	667.7500	487.458	19.753
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-07-11	2018-03-14	BANCO INTERNACIONAL	\$\$	CL	V	700.000	671.9500	470.365	21.844
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-08-01	2018-03-14	BANCO INTERNACIONAL	\$\$	CL	V	740.000	656.2000	485.588	11.586
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-08-02	2018-03-14	BANCO INTERNACIONAL	\$\$	CL	V	550.000	655.2000	360.360	8.068
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-08-10	2018-03-14	BANCO INTERNACIONAL	\$\$	CL	V	840.000	651.2000	547.008	9.005
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-08-21	2018-03-14	BANCO INTERNACIONAL	\$\$	CL	V	1.100.000	644.8000	709.280	4.843
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-08-24	2018-03-14	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	1.400.000	640.6700	896.938	456
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-07-18	2018-03-14	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	430.000	660.4800	284.006	8.549
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-07-19	2018-03-14	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	420.000	658.5200	276.578	7.538
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-07-26	2018-03-14	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	710.000	652.5900	463.339	8.586
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-07-28	2018-03-14	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	490.000	654.8500	320.877	7.019
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-05-10	2017-11-10	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	300.000	678.1300	203.439	11.859
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-05-18	2017-11-10	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	1.300.000	680.9500	885.235	55.043
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-05-26	2017-11-10	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	620.000	673.5700	417.613	21.689
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-06-06	2017-11-10	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	255.000	672.4000	171.462	8.623
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-06-14	2018-03-14	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	920.000	665.5500	612.306	22.896
1	Dólar	Forward	\$\$	2017-06-14	2018-03-14	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, CHILE	\$\$	CL	V	800.000	665.5200	532.416	19.886
TOTAL												271.496	

(1) Cifras en la moneda que corresponda con 4 decimales

(2) Cifras en miles de la moneda funcional del fondo, sin decimales

III. OTROS INFORMES

1) CONTRATOS DE OPCIONES CUANDO EL FONDO ACTUA COMO LANZADOR

Al 30 de septiembre de 2017, el Fondo no tiene contrato de opciones cuando actúa como lanzador.

2) OPERACIONES DE VENTA CON COMPROMISO DE RETROCOMPRA (VRC) Y DE COMPRA CON COMPROMISO DE RETROVENTA (CRV)

Al 30 de septiembre de 2017, el Fondo no mantiene operaciones de venta con compromiso de retrocompra y de compra con compromiso de retroventa.