

Enero 2023

Tipo de fondo  
Renta Fija - Dólar-Linked

### Información del fondo

Co-Heads Equipo de Inversiones  
Damián Lorenzo  
Matías Cremaschi, CFA

Portfolio Managers  
Damián Lorenzo

Patrimonio neto del fondo  
\$ 24.272.303.069

Fecha de Inicio del Fondo  
jul-05

Moneda de Suscripciones y rescates  
Pesos

Plazo de acreditación de rescates  
En 2 días hábiles

Sociedad depositaria  
Banco de Valores S.A.

Honorarios Sociedad Gerente  
2,25% anual

Honorarios anuales proporcionales a la  
estadía en el fondo

Honorarios Sociedad Depositaria  
0.10% + IVA anual

Comisión de Ingreso/Egreso  
No posee

Inversión Mínima<sup>1</sup>  
\$ 1.000,00

Calificación  
A+f (arg)

Código Bloomberg  
RJDGLOB AR

Código ISIN  
ARBVAL620MH3

Código CVSA  
4971

Información de contacto  
3752-7500  
info@deltaam.com.ar

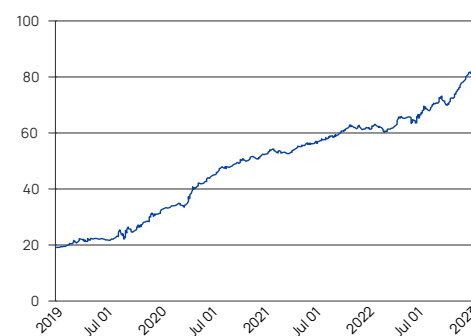
deltaam.com.ar

### Objetivo

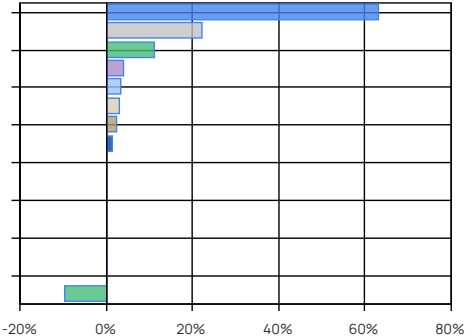
Delta Moneda es un fondo de renta fija que busca ofrecer un desempeño comparable a la evolución del tipo de cambio del dólar (Comunicación "A" 3500 BCRA) en el mediano/largo plazo. El fondo tiene una correlación positiva con el movimiento del tipo de cambio, sin representar una cobertura perfecta. En este sentido, el Fondo invierte al menos un 75,0% en activos de renta fija argentina dólar-linked (tanto soberanos como corporativos) y/o instrumentos de renta fija en pesos con cobertura de futuros de dólar en Rofex. Asimismo el fondo puede invertir hasta 10% del patrimonio en bonos en dólares. Pago de rescate en 2 días hábiles

| Performance                    | Clase B Institucional |
|--------------------------------|-----------------------|
| Mes                            | 3,55%                 |
| Año a la Fecha                 | 3,55%                 |
| Último año                     | 33,76%                |
| Últimos tres años anualizados  | 36,14%                |
| Últimos cinco años anualizados | 49,21%                |

### Evolución de la Cuotaparte



### Principales tenencias



### Principales tenencias

| Sector / Tipo de Activo                             | %             | Monto                    |
|---|---------------|--------------------------|
| Bonos Corporativos en Pesos USD-Linked Fija         | 63,12         | \$ 15.320.763.953        |
| Bonos Soberanos en Pesos Dual (USD-Linked/CER) Fija | 22,00         | \$ 5.340.933.837         |
| Pagares USD-Linked                                  | 11,16         | \$ 2.708.007.138         |
| Caja y Equivalentes                                 | 3,77          | \$ 915.830.665           |
| Bonos Soberanos en Dólares                          | 3,09          | \$ 750.464.157           |
| Bonos Soberanos en Pesos USD-Linked Fija            | 2,90          | \$ 703.244.400           |
| Bonos Corporativos en Dólares Fija                  | 2,12          | \$ 515.742.701           |
| Pases y Caucciones en Pesos Fija                    | 1,24          | \$ 300.000.000           |
| Bonos Corporativos en Pesos UVA Fija                | 0,06          | \$ 13.367.719            |
| Letras Soberanos en Pesos CER Fija                  | 0,05          | \$ 12.658.807            |
| Bonos Subsoberanos en Pesos BADLAR CABA             | 0,05          | \$ 11.396.050            |
| Bonos Corporativos en Dólares                       | 0,02          | \$ 5.314.066             |
| Bonos Corporativos en Pesos BADLAR                  | 0,02          | \$ 3.724.547             |
| Bonos Soberanos en Pesos Fija                       | 0,01          | \$ 2.120.757             |
| Letras Soberanos en Pesos Fija                      | 0,00          | \$ 33.596                |
| Otros Activos Netos                                 | -9,60         | \$ -2.331.299.326        |
| <b>Total</b>  | <b>100,01</b> | <b>\$ 24.272.303.069</b> |

Otros Activos Netos: incluye activos netos pendientes de liquidación, etc.  
Caja y Equivalentes: Incluye caja, operaciones a cobrar, etc.

### Performance histórica

| Año   | Ene   | Feb    | Mar    | Abr    | May   | Jun    | Jul   | Ago   | Sep   | Oct    | Nov    | Dic   | Retorno Acum. |
|-------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|---------------|
| 2023  | 3,55% |        |        |        |       |        |       |       |       |        |        |       | 3,55%         |
| 2022  | 2,48% | -2,17% | -0,22% | 5,90%  | 0,65% | 0,34%  | 5,12% | 1,66% | 0,86% | 1,75%  | 6,65%  | 5,79% | 32,38%        |
| 2021  | 2,66% | -0,25% | -1,90% | 3,76%  | 2,13% | 0,79%  | 2,74% | 1,15% | 2,52% | 3,65%  | -1,29% | 0,39% | 17,41%        |
| 2020  | 8,18% | 2,09%  | -1,95% | 20,36% | 4,30% | 4,98%  | 7,16% | 1,29% | 3,27% | 1,75%  | 1,95%  |       | 69,62%        |
| 2019  | 1,76% | 4,77%  | 8,41%  | -2,56% | 2,60% | -1,48% | 3,98% | 1,64% | 6,48% | 11,29% | 10,03% | 2,90% | 61,43%        |
| Prom. | 3,73% | 1,11%  | 1,09%  | 6,86%  | 2,42% | 1,16%  | 4,75% | 1,44% | 3,01% | 4,99%  | 4,28%  | 2,76% |               |

Corresponde a la evolución del Valor de la Cuotaparte (Institucional). Últimos 5 años.

Tratamiento impositivo. Personas físicas: Exento Impuesto sobre Débitos y Créditos. Gravado Bienes Personales. Exento de Impuesto a las Ganancias. Personas jurídicas: Exento Impuesto sobre Débitos y Créditos. Rescate gravado Impuesto a las Ganancias.