

Septiembre 2023

Tipo de fondo
Renta Fija - Dólar-Linked

Información del fondo

Chief Investment Officer
Matías Cremaschi, CFA

Portfolio Managers
Lilia Baracat
José Antonio Rivas Rivas

Patrimonio neto del fondo
\$ 65.987.573.164

Fecha de Inicio del Fondo
Julio 2005

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
\$ 1.000,00

Calificación
A+f(arg)

Código Bloomberg
RJDGLOB AR

Código ISIN
ARVAL620MH3

Código CVSA
4971.0

Información de contacto

info@deltaam.com.ar

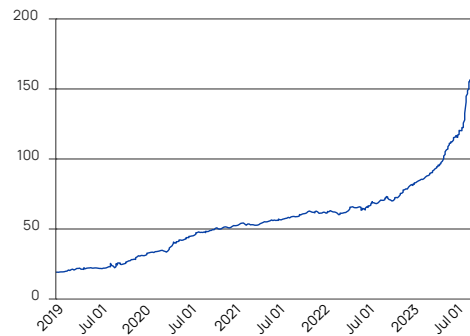
deltaam.com.ar

Objetivo

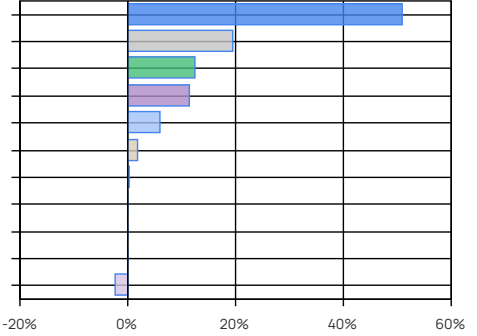
Delta Moneda es un fondo de renta fija que busca ofrecer un desempeño comparable a la evolución del tipo de cambio del dólar (Comunicación "A" 3500 BCRA) en el mediano/largo plazo. El fondo tiene una correlación positiva con el movimiento del tipo de cambio, sin representar una cobertura perfecta. En este sentido, el Fondo invierte principalmente en activos de renta fija argentina USD-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.

| Performance | Clase B Institucional |
|--------------------------------|-----------------------|
| Mes | -3,31% |
| Año a la Fecha | 84,69% |
| Último año | 112,01% |
| Últimos tres años anualizados | 45,42% |
| Últimos cinco años anualizados | 48,01% |

Evolución de la Cuotaparte



Principales tenencias



Principales tenencias

| Sector / Tipo de Activo | % | Monto |
|--|--------|-------------------|
| Bonos Corporativo en Pesos USD-Linked Fija | 50,99 | \$ 33.646.576.657 |
| Bonos Soberano en Pesos USD-Linked Fija | 19,44 | \$ 12.827.907.873 |
| Pagares USD-Linked | 12,53 | \$ 8.265.712.011 |
| Bonos Soberano en Pesos Dual (USD-Linked/CER) Fija | 11,41 | \$ 7.531.230.700 |
| Bonos Soberano en Dólares | 5,97 | \$ 3.940.995.321 |
| Caja y Equivalentes | 1,86 | \$ 1.225.886.893 |
| Bonos Corporativo en Dólares Fija | 0,13 | \$ 83.979.690 |
| Bonos Corporativo en Pesos UVA Fija | 0,03 | \$ 22.362.931 |
| Bonos Corporativo en Dólares | 0,02 | \$ 11.626.481 |
| Bonos Corporativo en Pesos BADLAR | 0,01 | \$ 7.887.108 |
| Otros Activos Netos | -2,39 | \$ -1.576.592.501 |
| Total | 100,00 | \$ 65.987.573.164 |

Otros Activos Netos: incluye activos netos pendientes de liquidación, etc.

Caja y Equivalentes: Incluye caja, operaciones a cobrar, etc.

El fondo cuenta con futuros de dólar comprados

Performance histórica

| Año | Ene | Feb | Mar | Abr | May | Jun | Jul | Ago | Sep | Oct | Nov | Dic | Retorno Acum. |
|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|-------|---------------|
| 2023 | 3,55% | 3,39% | 4,88% | 5,03% | 12,32% | 7,23% | 5,68% | 27,27% | -3,31% | | | | 84,69% |
| 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% | 2,20% | 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% | 1,57% | 1,85% | 6,50% | 4,40% | 2,37% | 4,94% | 6,60% | 1,75% | 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.