



RENDA FIJA ARGENTINA

Fecha de elaboración: 5/1/2024
Precios al cierre: 29/12/2023

Objetivo del Fondo: CYC Renta Fija Argentina buscará una atractiva relación de riesgo, rendimiento y plazo principalmente a través de instrumentos de renta fija en dólares de emisores de la Argentina. Tendrá mayormente títulos de renta fija corporativa pero podrá poseer (siempre respetando los parámetros de diversificación y riesgos establecidos) renta fija soberana o subsoberana. El fondo no tiene un objetivo de rendimiento y duration específico, sino que será flexible para adecuarse a los diferentes contextos.

Perfil del Inversor: Moderado

Horizonte de Inversión: Mediano Plazo

INFORMACIÓN GENERAL

| | |
|--|-------------------------------|
| Administrador | Sekoia Agente de Valores S.A. |
| Custodio: | Bank of New York Mellon |
| Estructurador | FlexFunds Ltd. |
| Fiduciario | Intertrust Group |
| Auditor | Roberts Nathan |
| ISIN | XS2223800819 |
| Bloomberg ID | ZO3670247 |
| Fecha de lanzamiento comercial | 11/5/2021 |
| Moneda: | Dólar estadounidense |
| Suscripción/Rescate: | Semanal |
| Honorarios de adm. y custodia (TER) | 1,2% anual |
| Costo Suscripción/Rescate: | Sin costo |
| Mínimo: | 1.000 VN |
| Patrimonio Neto: | USD 8.450.000 |
| NAV c/100 | USD 129,15 |

DATOS DE CARTERA

| | |
|------------------------|------|
| TIR* | 9,4% |
| Current Yield | 7,5% |
| Duration (to worst) | 2,06 |
| Duration (to maturity) | 2,55 |
| Cupón Promedio | 6,8% |
| Vto. Promedio (años) | 3,2 |
| Paridad Promedio | 90% |
| Cantidad de Activos | 23 |
| Índice de Sharpe | 1,71 |

*Utiliza current yield para paridades menores al 60%

RENDIMIENTOS

| | |
|------------------------------|-------|
| Desde lanzamiento* | 29,2% |
| Desde lanzamiento anualizado | 11,0% |
| 2021* | 5,9% |
| 2022 | 8,1% |
| 2023 | 12,9% |
| Rend. semanales positivos | 67% |

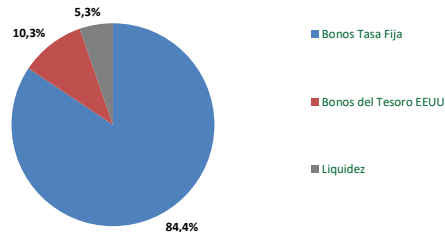
* desde lanzamiento 11/5/21

RIESGO

| | |
|--------------------------|------|
| Desvío d/ lanz. anualiz. | 4,1% |
|--------------------------|------|

* desde lanzamiento 11/5/21

TIPOS DE ACTIVO



UBICACIÓN

| Ubicación | % |
|-----------|--------|
| Argentina | 84,4% |
| EEUU | 15,6% |
| Total | 100,0% |

EMISOR

| Emisor | % |
|---------------|--------|
| Corporativo | 84,4% |
| Soberano EEUU | 10,3% |
| Liquidez | 5,3% |
| Total | 100,0% |

SECTORES

| Sector | % |
|-----------------------|--------|
| Oil & Gas | 17,0% |
| Serv. Públicos | 15,7% |
| Transporte de Energía | 14,3% |
| Real Estate | 13,5% |
| Transporte | 10,6% |
| Bonos del Tesoro EEUU | 10,3% |
| Financiero | 7,7% |
| Liquidez | 5,3% |
| Comunicaciones | 2,4% |
| Consumo Masivo | 2,2% |
| Energía Renovable | 1,0% |
| Total | 100,0% |

TENENCIAS

| Tenencia | % |
|----------------------------------|--------|
| TGS 6,75% 2025 | 14,3% |
| Capex 9,25% 2028 | 9,8% |
| Pampa Energía 9,125% 2029 | 9,5% |
| BMA 6,75% 2026 | 7,7% |
| Aeropuertos Arg 2000 8,5% 2031 | 7,4% |
| Raghsa 8,5% 2027 | 6,6% |
| Raghsa 7,25% 2024 | 5,7% |
| Liquidez | 5,3% |
| Pampa Energía 7,5% 2027 | 3,9% |
| US Treasury Bill 05/09/24 | 3,4% |
| Aeropuertos Arg 2000 6,875% 2027 | 3,2% |
| YPF 7% 2033 | 3,0% |
| YPF 8,5% 2029 | 2,7% |
| Telecom 8,5% 2025 | 2,4% |
| Clisa 5,25% 2027 | 2,3% |
| US Treasury Bill 22/02/24 | 2,3% |
| US Treasury Bill 18/04/24 | 2,3% |
| Arcor 8,25% 2027 | 2,2% |
| CGC 9,5% 2025 | 1,6% |
| US Treasury Bill 16/05/24 | 1,2% |
| Raghsa 8,25% 2030 | 1,2% |
| US Treasury Bill 03/10/24 | 1,1% |
| Genneia 8,75% 2027 | 1,0% |
| Total | 100,0% |

EVOLUCION NAV

