

ALL METRICS OPTIMAL BOND FUND

Investment Manager

Gletir Corredor de Bolsa S.A.

Fecha de lanzamiento del fondo

09/10/2020

NAV (USD)

USD 94,495-*

Rendimiento directo Bloomberg Global Aggregate desde inicio

(5,08)

Rendimiento directo del fondo desde inicio

(5,50)

Actualización

Mensual

Administrador

JTC Fund Services Ltd.

Auditor

PriceWaterhouseCoopers

Agente de pago

MUFG Union Bank, N.A.

Custodia

BNY Mellon Corporation

Códigos

CUSIP: G0218G154

ISIN: KYG0218G1543

VALOREM: CH056635607

BLOOMBERG: ALOBNAU KY

GIIN #: DFGRMN.00004.ME.136

*NAV calculado al 28/02/2022

OBJETIVO DEL FONDO

All Metrics Optimal Bond Fund ofrece exposición al mercado de renta fija global mediante un portafolio eficiente. Utiliza herramientas y algoritmos de optimización para obtener la mejor relación existente entre riesgo y retorno

HIGHLIGHTS

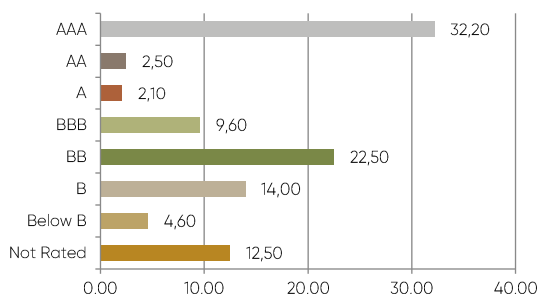
- Baja a moderada exposición al riesgo
- Optimiza la relación riesgo retorno dentro del universo de renta fija global
- Invierte en Exchange Traded Funds (ETFs), instrumentos de renta fija y los mejores fondos de la industria.

| ACTIVOS | Set de Portafolios Eficientes | | | | | | |
|----------------|---------------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | Índices | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| UST 1-3 | BBgBarc US Treasury 1-3 Yr | 65,46 | 72,38 | 40,52 | 12,58 | 0,00 | 0,00 |
| UST 3-10 | BBgBarc US Treasury 3-10 Yr | 0,00 | 0,83 | 4,21 | 2,68 | 0,00 | 0,00 |
| USD +10 | BBgBarc US Treasury Long | 0,00 | 2,35 | 8,03 | 14,99 | 19,64 | 0,00 |
| US CORP 1-3 | BBgBarc US Corp 1-3 Yr | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| US CORP 1-10 | BBgBarc Interm Corp | 0,00 | 0,06 | 0,24 | 0,02 | 0,00 | 0,00 |
| US CORP +10 | BBgBarc US Long Corporate | 0,00 | 0,74 | 1,94 | 3,11 | 0,00 | 0,00 |
| INT CORP | BBgBarc Gbl Agg Ex USD | 0,00 | 0,08 | 0,26 | 0,49 | 0,00 | 0,00 |
| US TIPS | BBgBarc US Treasury US TIPS | 0,00 | 0,24 | 0,88 | 0,85 | 0,00 | 0,00 |
| FLOAT | BBgBarc USFRN 5- Yr TR USD | 34,54 | 0,95 | 0,22 | 0,02 | 0,00 | 0,00 |
| CONV | BBgBarc US Cnvt Lq Bond | 0,00 | 0,45 | 0,78 | 1,12 | 0,00 | 0,00 |
| EMERGENTES | BBgBarc EM USD Aggregate | 0,00 | 11,75 | 24,87 | 38,01 | 45,57 | 100,0 |
| INT HIGH YIELD | BBgBarc Global High Yield | 0,00 | 10,18 | 18,06 | 26,14 | 34,79 | 0,00 |
| US HIGH YIELD | BBgBarc US Corporate High Yield | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| IMPLIED RETURN | | 1,66 | 2,47 | 3,25 | 4,04 | 4,46 | 4,81 |
| VOLATILITY | | 0,85 | 1,87 | 3,61 | 5,44 | 6,29 | 8,13 |
| SHARPE RATIO | | -0,40 | 0,252 | 0,346 | 0,375 | 0,390 | 0,346 |
| YTM | | 1,44 | 2,71 | 3,72 | 4,72 | 5,42 | 5,65 |
| DURATION | | 1,365 | 3,378 | 5,497 | 7,595 | 8,417 | 7,000 |

ALL METRICS OPTIMAL BOND FUND

| Cartera Actual | |
|-----------------------------|-------|
| Index | |
| BBgBarc US Treasury 1-3 Yr | 14,45 |
| BBgBarc US Treasury 3-10 Yr | 4,61 |
| BBgBarc US Corp 1-3 Yr | 10,34 |
| BBgBarc US Long Corporate | 0,87 |
| BBgBarc US Treasury US TIPS | 2,11 |
| BBgBarc EM USD Aggregate | 28,19 |
| BBgBarc Global HY | 19,94 |
| BBgBarc US Corporate HY | 13,40 |
| Cash | 6,09 |

Calidad del credito renta fija



INFORMACION IMPORTANTE

El presente documento sirve de base para una discusión posterior y no debe ser interpretado como jurídicamente vinculante. La presente consiste de una oferta privada, no pudiendo ser realizada de forma pública en virtud de la Ley de Mercado de Valores uruguaya número 18.627, salvo que la misma se registre de acuerdo con los términos y condiciones establecidas en la mencionada ley. Con respecto a dicha restricción, la presente oferta puede ser ofrecida únicamente en forma directa a personas físicas o jurídicas determinadas. Por lo tanto, deberá efectuarse de forma directa y caso por caso, sin realizar ningún tipo de publicidad, presentaciones públicas o solicitudes generales, asimismo no se ofrecerá en Bolsa de Valores alguna, salvo en cuanto se establezca lo contrario en el Offering Memorandum All Metrics Asset Management SPC. La oferta aquí es estrictamente confidencial y no puede ser distribuida por los destinatarios de este documento. El material contenido en esta presentación puede incluir breve información financiera y declaraciones, pero ni el Administrador, ni el Investment Manager, ni All Metrics Asset Management SPC, ni los Agentes Distribuidores o sus respectivas afiliadas hacen ninguna declaración o garantía, expresa o implícita, con respecto a la exactitud o integridad de esta información y nada de lo aquí contenido debe ser considerado como una promesa o declaración de que el rendimiento pasado será indicativo del rendimiento futuro. La información presentada puede no estar actualizada, y aunque la información y los conceptos reflejan buena fe, conocimientos, expectativas, estimaciones y / o proyecciones, no consisten de ninguna garantía y pueden estar sujetos a cambios. Ninguna de las entidades antedichas se compromete ante usted a actualizar ninguna información. Al adoptar una decisión de invertir, los inversores deben basarse únicamente en su propio análisis de la inversión, en sus características y en los riesgos que conlleva su decisión de invertir. Por lo tanto, los posibles inversores reconocen y entienden que: (i) es su propia responsabilidad obtener (a su propio cargo) el asesoramiento legal, fiscal, financiero y de cualquiera otra índole que considere necesarios o apropiados en relación con la inversión; (ii) existen riesgos sustanciales en la inversión, que deben ser considerados y analizados minuciosamente por los inversores con sus propios asesores; (iii) ni el Administrador, ni el Investment Manager, ni All Metrics Asset Management SPC, ni los Agentes Distribuidores o sus respectivas afiliadas brindan ningún tipo de seguridad o garantía con respecto a los resultados de la inversión. El contenido de este documento no debe ser interpretado como asesoramiento legal, comercial, financiero, impositivo y/o de otro tipo. El público inversor deberá consultar con sus propios asesores respecto de los aspectos y convenciones legales, comerciales, financieros, impositivos y/o de otro tipo relacionados con su inversión All Metrics Optimal Bond Fund SP. Ni el Administrador, ni el Investment Manager, ni All Metrics Asset Management SPC, ni los Agentes Distribuidores o sus respectivas afiliadas (y sus respectivos directores, funcionarios, agentes y empleados) serán responsables ante el inversionista por cualquier reclamo, pérdida, daño, responsabilidad, costo o gasto sufrido, en referencia a la inversión.