



## Descripción del Fondo

El objetivo del fondo es invertir los recursos en activos de renta variable, de deuda. Lo anterior de manera directa o a través de vehículos de inversión colectiva tales como fondos de Inversión, títulos referenciados a acciones (Trackers) y/o Exchange Traded Funds (ETFs).

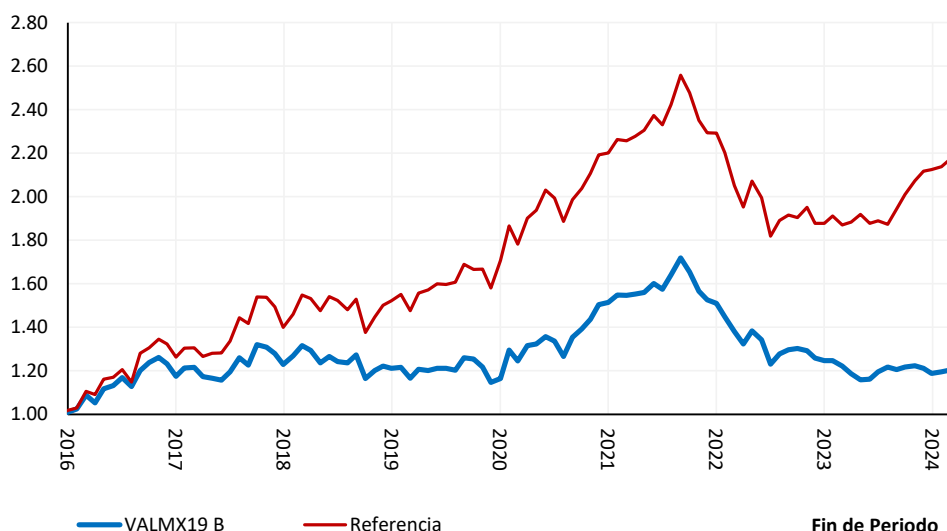
Información al 31 mayo 2024

### Portafolio de referencia

100.0% iShares MSCI All Country World

## Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



### Principales riesgos

Cambios: Exposición a monedas

Capitales: Exposición a mercados globales

### El fondo en números

#### Activos netos

\$6,883 millones de Pesos

#### Resumen Rendimientos:

	0.68	1.71	-1.04
Mayo	0.68	1.71	-1.04
YTD	-1.16	8.18	-9.34
12 meses	-1.48	16.21	-17.69
Histórico*	2.27	9.87	-7.60

\* Datos de febrero 2016 a mayo 2024.

#### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	2.95%
Error de rastreo:	1.83%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	0.9887 0.0060

#### Valor en Riesgo (a 1 día el 97.5% de confianza):

VaR (4) y límite de VaR:	0.84%	5.75%
Consumo de VaR		15%

#### Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Mayo	Abril	Marzo	YTD	3 meses	6 meses
VALMX19 B	0.68	0.72	-1.96	-1.16	-0.59	-0.15
Referencia	1.71	0.61	0.36	8.18	2.71	11.89
Diferencia	-1.04	+0.10	-2.33	-9.34	-3.30	-12.04

#### Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX19 B	-1.48	-8.03	0.66	-0.14		2.27
Referencia	16.21	-1.24	8.05	7.55		9.87
Diferencia	-17.69	-6.79	-7.39	-7.69		-7.60

\* Datos de feb-16 a may-24 de ser necesario se reconstruye la serie B a partir de la serie del capital fijo "A".

#### Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B):	0.56%
Administración:	0.10%
Distribución:	0.46%

#### Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VA2T0047
Ticker	VALMX19 B

#### Operación del fondo:

Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 07:30 a 13:00

\* Los horarios pueden cambiar dependiendo de los días y horas hábiles en México, EE.UU. y en Europa.

#### Caídas mensuales más importantes

Retorno total		Retorno relativo		Retorno total		Retorno relativo	
Dic-2018	-8.5%	Mar-2020	-6.4%	Abr-2020	+11.2%	Oct-2023	+2.8%
Sep-2022	-8.3%	Nov-2016	-5.0%	Dic-2017	+7.7%	Oct-2018	+2.4%
Feb-2020	-5.8%	Nov-2023	-4.7%	Nov-2020	+7.0%	Ago-2023	+2.4%
Ene-2022	-5.3%	Jul-2023	-4.2%	Nov-2016	+6.5%	Mar-2018	+2.3%
Oct-2020	-5.3%	Jun-2023	-3.6%	Jul-2016	+6.2%	Sep-2023	+2.3%

#### Alzas mensuales más importantes

NOTA IMPORTANTE: Los rendimientos históricos, no son garantizan rendimientos futuros.



## Portafolio

Información al 31 mayo 2024

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Deuda Moneda Extranjera	-	81.0%
Capitales Globales	100.0%	16.9%
Efectivo / Fondo	-	2.0%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Gobierno Federal	26.0%
Financieros	15.9%
Multi-Sectorial	13.4%
Efectivo / Fondo	2.0%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	41.2%
Euro Zona	15.9%
América Latina	0.2%

Distribución por plazo (solo deuda)	
Fondo / Tracker	81.0%
0-3 meses	2.0%
<b>Total deuda (duración bonos en directo 2.0% = 0.0 años)</b>	<b>83.1%</b>

Distribución por calificación (solo deuda)	
Tracker / Fondo	55.1%
Fondeo diario	2.0%
Gobierno Federal	26.0%
<b>Total deuda</b>	<b>83.1%</b>

Principales 10 tenencias	
Valmex - Deuda Global (VLMXDME)	42.7%
iShares Treasury Bond 7-10 year UCITS (CBU0)	14.8%
Vanguard USD Corporate Bond UCITS ETF (VDPA)	12.9%
iShares Treasury Bond 3-7 year UCITS (CBU7)	9.8%
iShares \$ Short Duration Corp Bond UCITS (SDIA)	6.3%
iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF USD (IMBA)	6.1%
iShares \$ TIPS UCITS ETF USD (IDTP)	3.0%
Saldo Efectivo Dólares	1.8%
iShares Short Treasury Bond UCITS (IB01)	1.4%
Vangard US Treasury 0-1 Bond UCITS ETF (USD) Accumulating (VDS)	1.0%
<b>Total</b>	<b>99.8%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	11
Diversificación (1/Herfindahl)	4

## Portafolio por monedas

Pesos	42.9%
UDIs	-
Dólares (EUA)	57.1%
Euros	-

## Información adicional

## Posibles adquirientes (sub series):

Personas Físicas, Personas morales, No contribuyentes, Cajas y fondos de ahorro.

## Clasificación y Autorización CNBV:

Fondo de inversión especializado en Mercados accionarios globales. Oficio No. 157/9791/2020 con fecha 30 de abril del 2020

## Administración

Operador: Operadora Valmex de Fondos de Inversión S.A de C.V. / Custodio: Valores Mexicanos Casa de Bolsa S.A de C.V. / Proveedor de precios: Proveedor Integral de Precios S.A de C.V.

## Contactos

Legaría 549 Torre 2 Piso 7  
 Colonia 10 de abril  
 Alcaldía Miguel Hidalgo  
 11250 Ciudad de México  
 Teléfono (55) 5279-1200  
[www.valmex.com.mx](http://www.valmex.com.mx)

**Notas:** (1) Todos los rendimientos son netos de comisiones, aquellos menores a un año son tasas efectivas, las mayores a un año son efectivas anualizadas. (2) Se emplean 36 observaciones mensuales, con un mínimo de 12; la volatilidad mide la dispersión de los rendimientos, mientras que el error de rastreo mide la dispersión del rendimiento relativo a la referencia; la beta ( $\beta$ ) mide la relación y sensibilidad de los retornos con respecto a la referencia; finalmente, el alfa ( $\alpha$ ) mide el exceso de rendimiento sobre la referencia. (3) El VaR (Valor en Riesgo) mide la pérdida esperada, en 1 día, del fondo on un 97.5% de confianza, esta medida de riesgo se calcula con un modelo histórico

**Declaración de responsabilidad:** La información aquí contenida es únicamente con fines informativos y sin ningún tipo de validez oficial y/o legal, y no debe ser interpretada como una oferta, sugerencia o invitación para comprar, vender o realizar otro tipo de operaciones con valor alguno. Los rendimientos son históricos y no existe garantía de que en un futuro tengan el mismo comportamiento. Para obtener mayor información del fondo, puede consultar el prospecto de información al público inversionista en [www.valmex.com.mx](http://www.valmex.com.mx). Es importante consultar con su asesor cual es su perfil de inversión. Este documento no puede ser reproducido total o parcialmente sin la autorización de Valores Mexicanos Casa de Bolsa, SA de CV