



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).

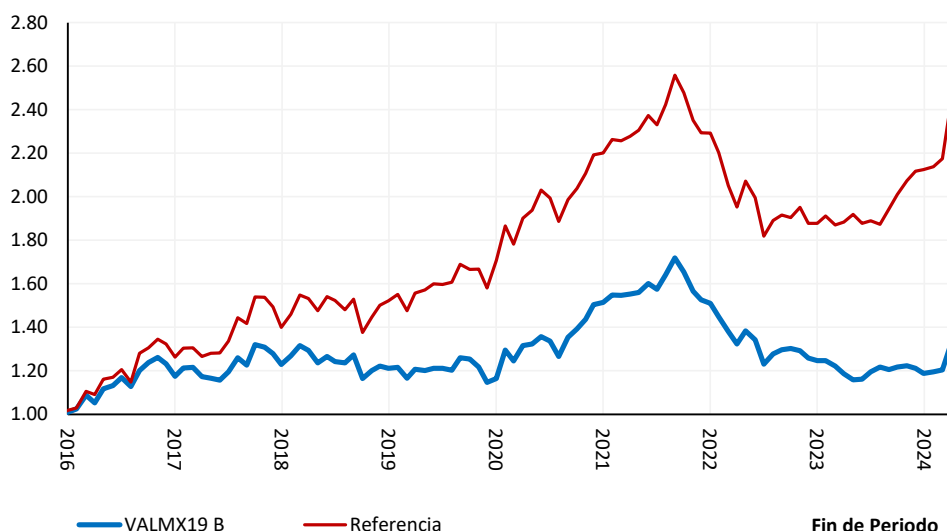
Información al 28 junio 2024

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

\$7,492 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

	Junio	11.64	-1.94
Junio	9.69	11.64	-1.94
YTD	8.42	20.77	-12.35
12 meses	11.37	28.85	-17.48
Histórico*	3.39	11.23	-7.83

* Datos de febrero 2016 a junio 2024.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	3.42%
Error de rastreo:	1.84%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0245 0.0065

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

VaR (4) y límite de VaR:	0.87%	5.75%
Consumo de VaR		15%

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Junio	Mayo	Abril	YTD	3 meses	6 meses
VALMX19 B	9.69	0.68	0.72	8.42	11.23	8.42
Referencia	11.64	1.71	0.61	20.77	14.25	20.77
Diferencia	-1.94	-1.04	+0.10	-12.35	-3.02	-12.35

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX19 B	11.37	-5.25	1.81	1.71		3.39
Referencia	28.85	2.13	9.28	9.75		11.23
Diferencia	-17.48	-7.38	-7.47	-8.03		-7.83

* Datos de feb-16 a jun-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%	Jun-2024	+9.7%	Oct-2018	+2.4%
Feb-2020	-5.8%	Nov-2023	-4.7%	Dic-2017	+7.7%	Ago-2023	+2.4%
Ene-2022	-5.3%	Jul-2023	-4.2%	Nov-2020	+7.0%	Mar-2018	+2.3%
Oct-2020	-5.3%	Jun-2023	-3.6%	Nov-2016	+6.5%	Sep-2023	+2.3%

Alzas mensuales más importantes

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



Portafolio

Información al 28 junio 2024

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Deuda Moneda Extranjera	-	81.2%
Capitales Globales	100.0%	16.8%
Efectivo / Fondo	-	2.0%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Gobierno Federal	25.9%
Financieros	15.9%
Multi-Sectorial	13.3%
Efectivo / Fondo	2.0%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	41.1%
Euro Zona	15.9%
América Latina	0.1%

Distribución por plazo (solo deuda)	
Fondo / Tracker	81.2%
0-3 meses	2.0%
Total deuda (duración bonos en directo 2.0% = 0.0 años)	83.2%

Distribución por calificación (solo deuda)	
Tracker / Fondo	55.3%
Fondeo diario	2.0%
Gobierno Federal	25.9%
Total deuda	83.2%

Principales 10 tenencias	
Valmex - Deuda Global (VLMXDME)	42.9%
iShares Treasury Bond 7-10 year UCITS (CBU0)	14.8%
Vanguard USD Corporate Bond UCITS ETF (VDPA)	12.8%
iShares Treasury Bond 3-7 year UCITS (CBU7)	9.7%
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%
Total	99.9%

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación

Número de emisoras	11
Diversificación (1/Herfindahl)	4

Portafolio por monedas

Pesos	43.0%
UDIs	-
Dólares (EUA)	57.0%
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

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 (β) mide la relación y sensibilidad de los retornos con respecto a la referencia; finalmente, el alfa (α) 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. 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