



Descripción del Fondo

El fondo tiene como objetivo ofrecer al público inversionista una alternativa de inversión cuya estrategia busque superar el rendimiento del S&P/BMV Índice de Precios y Cotizaciones de la Bolsa Mexicana de Valores (BMV).

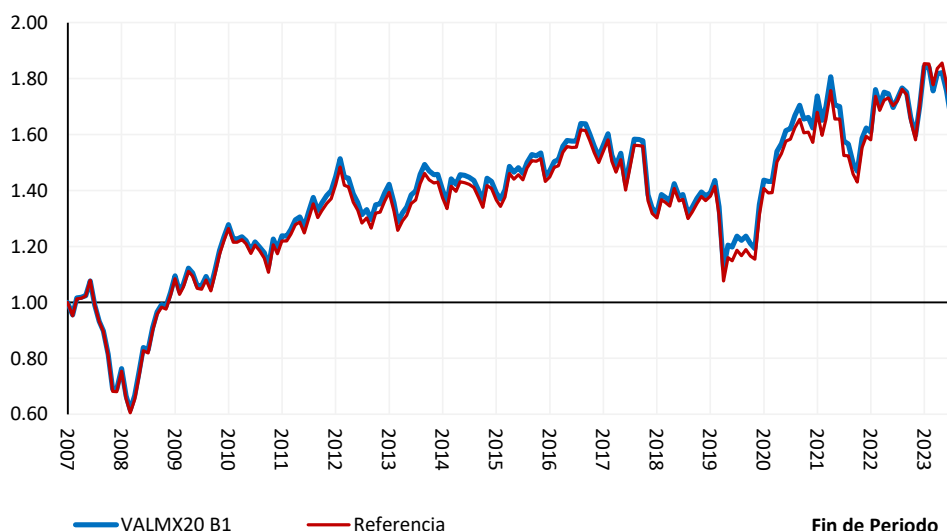
Información al 28 junio 2024

Portafolio de referencia

100.0% S&P/BMV IRT

Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Principales riesgos

Capitales: Exposición al mercado de México

El fondo en números

Activos netos

\$259.2 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

| | VALMX20 B1 | Referencia | Diferencia |
|------------|------------|------------|------------|
| Junio | -5.11 | -5.04 | -0.07 |
| YTD | -9.61 | -8.70 | -0.91 |
| 12 meses | -3.53 | -1.55 | -1.98 |
| Histórico* | 3.14 | 3.24 | -0.10 |

* Datos de diciembre 2007 a junio 2024.

Datos estadísticos (2):

| | |
|--------------------------------------|-----------------|
| Volatilidad: | 4.39% |
| Error de rastreo: | 0.47% |
| Beta (β) / Alfa (α) | 1.0261 / 0.0011 |

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

| | | |
|--------------------------|-------|-------|
| VaR (4) y límite de VaR: | 1.74% | 2.71% |
| Consumo de VaR | 64% | |

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

| | Junio | Mayo | Abril | YTD | 3 meses | 6 meses |
|------------|-------|-------|-------|-------|---------|---------|
| VALMX20 B1 | -5.11 | -3.62 | 0.26 | -9.61 | -8.30 | -9.61 |
| Referencia | -5.04 | -3.94 | 1.05 | -8.70 | -7.83 | -8.70 |
| Diferencia | -0.07 | +0.33 | -0.79 | -0.91 | -0.48 | -0.91 |

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

| | 12 meses | 3 años | 5 años | 7 años | 10 años | Histórico* |
|------------|----------|--------|--------|--------|---------|------------|
| VALMX20 B1 | -3.53 | 0.92 | 3.76 | 0.79 | 1.77 | 3.14 |
| Referencia | -1.55 | 2.24 | 4.34 | 1.22 | 2.16 | 3.24 |
| Diferencia | -1.98 | -1.32 | -0.58 | -0.43 | -0.39 | -0.10 |

* Datos de dic-07 a jun-24 de ser necesario se reconstruye la serie B1 a partir de la serie del capital fijo "A".

Algunos datos prácticos

| | |
|--------------------------------|-------|
| Comisiones anuales (serie B1): | 2.13% |
| Administración: | 0.38% |
| Distribución: | 1.75% |

Como encontrar el fondo:

| | |
|--------|--------------|
| ISIN | MX52VA200000 |
| Ticker | VALMX20 B1 |

Operación del fondo:

| | |
|---------------------|------------------|
| Liquidez (compra) | Diaria |
| Liquidez (venta) | Diaria |
| Plazo liquidación | 48 Horas |
| Horario operación * | De 08:30 a 14:30 |

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

Caídas mensuales más importantes

| Caídas mensuales más importantes | | Alzas mensuales más importantes | |
|----------------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| Retorno total | Retorno relativo | Retorno total | Retorno relativo |
| Mar-2020 | -16.5% | May-2023 | -1.2% |
| Oct-2008 | -15.3% | Nov-2023 | -1.2% |
| Ene-2009 | -12.8% | Abr-2023 | -0.8% |
| Oct-2018 | -12.3% | Abr-2024 | -0.8% |
| Sep-2008 | -9.3% | Dic-2020 | -0.8% |
| | | Nov-2020 | +13.2% |
| | | Mar-2020 | +1.4% |
| | | Abr-2009 | +13.1% |
| | | Feb-2020 | +0.9% |
| | | May-2009 | +11.3% |
| | | Jun-2023 | +0.8% |
| | | Dic-2008 | +10.7% |
| | | Ene-2021 | +0.7% |
| | | Jul-2009 | +9.4% |
| | | Ene-2020 | +0.7% |

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



Portafolio

Información al 28 junio 2024

| Distribución por mercado | Referencia | Portafolio |
|--------------------------|------------|------------|
| Capitales México | 100.0% | 97.5% |
| Efectivo / Fondo | - | 2.5% |

| Distribución por sector (deuda y capitales) | |
|---|-------|
| Consumo frecuente | 31.2% |
| Materiales | 20.3% |
| Financieros | 16.8% |
| Industrial | 16.2% |
| Comunicaciones | 9.6% |
| Consumo no básico | 3.5% |
| Efectivo / Fondo | 2.5% |

| Principales 10 tenencias | |
|--|--------------|
| Fomento Económico Mexicano (FEMSA) | 12.2% |
| Grupo Financiero Banorte (GFNORTE) | 11.6% |
| Grupo México (GMEXICO) | 8.4% |
| Wal-Mart de México (WALMEX) | 8.3% |
| América Móvil (AMX) | 7.7% |
| Cementos Mexicanos (CEMEX) | 6.8% |
| Grupo Aeroportuario del Pacífico (GAP) | 5.7% |
| Corporación Inmobiliaria Vesta (VESTA) | 4.2% |
| Grupo Aeroportuario del Sureste (ASUR) | 3.9% |
| Grupo Cementero Chihuahua (GCC) | 3.3% |
| Total | 72.2% |

Datos del portafolio

| Emisoras y deversificación | |
|--------------------------------|----|
| Número de emisoras | 24 |
| Diversificación (1/Herfindahl) | 15 |

| Portafolio por monedas | |
|------------------------|--------|
| Pesos | 100.0% |
| UDIs | - |
| Dólares (EUA) | - |
| Euros | - |

Información adicional

| Posibles adquirientes (sub series): | |
|---|--|
| Personas Físicas, Personas morales, Personas no sujetas a retención nacionales y/o extranjeras. | |

| Clasificación y Autorización CNBV: | |
|--|--|
| Fondo de inversión especializado en Mercados accionarios en México. Oficio No. 157/13036/2021 con fecha 26 de febrero del 2021 | |

| 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 con 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