

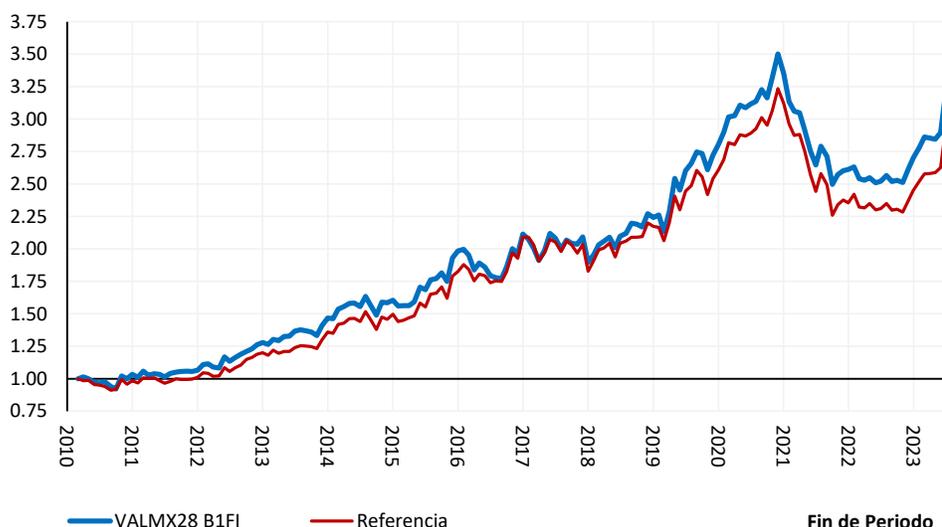


Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es invertir los recursos captados del público inversionista en Acciones y otros vehículos de inversión colectiva como ETF's (Exchange Traded Funds) y Fondos de Inversión, de los mercados de capitales y de deuda nacionales e internacionales, desarrollados y emergentes, listados en el SIC (Sistema Internacional de Cotizaciones). El fondo busca preservar el capital en el largo plazo a través de la diversificación a lo largo de sectores y regiones, buscando aquellos que ofrecen mayor potencial de crecimiento, pero con menor riesgo.

Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

| | Junio | Mayo | Abril | YTD | 3 meses | 6 meses |
|---------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| VALMX28 B1FI | 10.85 | 1.78 | -0.38 | 18.85 | 12.40 | 18.85 |
| Referencia | 11.78 | 1.46 | 0.32 | 19.81 | 13.77 | 19.81 |
| Diferencia | -0.93 | +0.33 | -0.70 | -0.96 | -1.37 | -0.96 |

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

| | 12 meses | 3 años | 5 años | 7 años | 10 años | Histórico* |
|---------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| VALMX28 B1FI | 27.26 | 0.99 | 8.87 | 8.67 | 8.91 | 9.14 |
| Referencia | 27.09 | 0.52 | 7.51 | 7.76 | 9.00 | 8.41 |
| Diferencia | +0.17 | +0.48 | +1.36 | +0.92 | -0.09 | +0.73 |

* Datos de feb-11 a jun-24 de ser necesario se reconstruye la serie B1FI a partir de la serie del capital fijo "A".

| Caídas mensuales más importantes | | | | Alzas mensuales más importantes | | | |
|----------------------------------|-------|------------------|-------|---------------------------------|--------|------------------|-------|
| Retorno total | | Retorno relativo | | Retorno total | | Retorno relativo | |
| Dic-2018 | -9.4% | Sep-2011 | -2.7% | Abr-2020 | +11.1% | Oct-2018 | +2.8% |
| Sep-2022 | -8.0% | Mar-2012 | -2.5% | Jun-2024 | +10.8% | Mar-2011 | +2.8% |
| Ene-2022 | -6.5% | Ene-2017 | -2.3% | Oct-2011 | +10.8% | Oct-2011 | +2.6% |
| Mar-2017 | -5.9% | Ene-2023 | -2.1% | Nov-2016 | +10.3% | Ago-2019 | +2.2% |
| Feb-2020 | -5.7% | Sep-2013 | -2.0% | May-2013 | +8.0% | Jul-2011 | +1.8% |

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

Información al 28 junio 2024

Portafolio de referencia

100.0% MSCI ACWI Index (net)

Principales riesgos

Cambios: Exposición a varias monedas
 Capitales: Exposición a mercados globales

El fondo en números

Activos netos

\$11,662 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

| | | | |
|------------|--------------|--------------|--------------|
| Junio | 10.85 | 11.78 | -0.93 |
| YTD | 18.85 | 19.81 | -0.96 |
| 12 meses | 27.26 | 27.09 | +0.17 |
| Histórico* | 9.14 | 8.41 | +0.73 |

* Datos de febrero 2011 a junio 2024.

Datos estadísticos (2):

| | |
|---------------------|----------------|
| Volatilidad: | 3.77% |
| Error de rastreo: | 0.76% |
| Beta (β) / Alfa (α) | 1.0443 -0.0004 |

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

| | | |
|--------------------------|-------|-------|
| VaR (4) y límite de VaR: | 1.04% | 4.50% |
| Consumo de VaR | | 23% |

Algunos datos prácticos

| | |
|---|--------------|
| Comisiones anuales (serie B1FI): | 0.53% |
| Administración: | 0.10% |
| Distribución: | 0.43% |

Como encontrar el fondo:

| | |
|--------|--------------|
| ISIN | MX52VA130016 |
| Ticker | VALMX28 B1FI |

Operación del fondo:

| | |
|---------------------|------------------|
| Liquidez (compra) | Diaria |
| Liquidez (venta) | Diaria |
| Plazo liquidación | 48 Horas |
| Horario operación * | De 07:30 a 12:00 |

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



Portafolio

Información al 28 junio 2024

| Distribución por mercado | Referencia | Portafolio |
|--------------------------|------------|------------|
| Capitales Globales | 100.0% | 92.7% |
| Fondo Mixto | - | 5.7% |
| Efectivo / Fondeo | - | 1.6% |

| Distribución por sector (deuda y capitales) | |
|---|-------|
| Multi-Sectorial | 61.9% |
| Salud | 8.7% |
| Industrial | 3.1% |
| Financieros | 2.4% |
| Efectivo / Fondeo | 1.6% |
| Energía | 1.3% |

| Distribución por región (incluye deuda y capitales) | |
|---|-------|
| Norte-América | 49.7% |
| Multi-región | 36.0% |
| Euro Zona | 8.9% |
| Asia-Pacífico | 5.3% |
| América Latina | 0.2% |

| Principales 10 tenencias | |
|--|--------------|
| Valmex - JP Morgan: US Technology (VLMXTEC) | 20.9% |
| Valmex - Brandes: Value Equities (VALMXVL) | 14.0% |
| iShares Edge MSCI USA Quality Factor ETF (QUAL) | 12.2% |
| Vanguard Dividend Appreciation (VIG) | 9.4% |
| Valmex - Alliance Bernstein LP (VALMXHC) | 8.7% |
| iShares Edge MSCI Intl Quality Factor ETF (IQLT) | 6.1% |
| Valmex - MIROVA Global ESG (VLMXESG) | 5.7% |
| iShares MSCI EMU (EZU) | 4.3% |
| iShares MSCI Japan UCITS ETF (CJPU) | 4.3% |
| iShares Dow Jones US Aerospace & Defense (ITA) | 3.1% |
| Total | 88.8% |

Datos del portafolio

| Emisoras y deversificación | |
|--------------------------------|----|
| Número de emisoras | 18 |
| Diversificación (1/Herfindahl) | 9 |

| Portafolio por monedas | |
|------------------------|-------|
| Pesos | 51.8% |
| UDIs | - |
| Dólares (EUA) | 48.2% |
| Euros | - |

Información adicional

| Posibles adquirientes (sub series): | |
|---|--|
| Personas físicas, Personas morales, Cajas y fondos de ahorro. | |

| Clasificación y Autorización CNBV: | |
|--|--|
| Fondo de inversión especializado en Mercados accionarios globales. Oficio No. 157/9803/2020 con fecha 12 de junio 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 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