



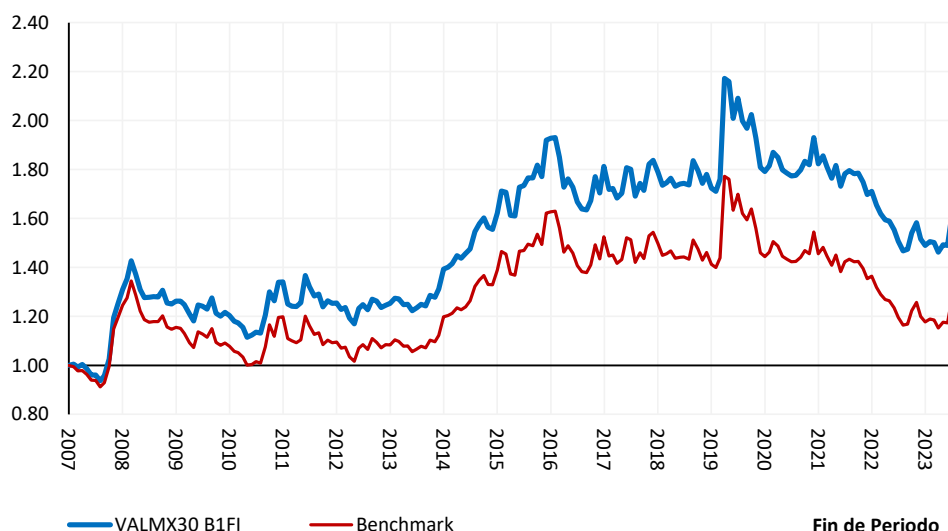
## Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es ofrecer una alternativa de cobertura cambiaria respecto al Dólar americano. La inversión principal será en depósitos en chequera denominados en Dólares y en papeles gubernamentales de deuda denominados en Dólares americanos (Bonos UMS).

Información al 28 junio 2024

## Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Junio	Mayo	Abril	YTD	3 meses	6 meses
VALMX30 B1FI	8.11	-0.21	2.03	8.07	10.08	8.07
Benchmark	8.15	-0.24	2.02	7.75	10.07	7.75
Diferencia	-0.03	+0.03	+0.01	+0.32	+0.01	+0.32

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX30 B1FI	6.85	-3.16	-1.57	-0.51	2.68	2.93
Benchmark	6.05	-3.77	-2.54	-1.47	1.75	1.45
Diferencia	+0.80	+0.61	+0.96	+0.97	+0.94	+1.48

\* Datos de dic-07 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	
May-2020	-7.0%	Nov-2011	-1.0%	Mar-2020	+23.4%	Oct-2011	+1.2%
Ene-2012	-6.8%	Dic-2014	-0.7%	Oct-2008	+16.4%	Mar-2008	+1.1%
Mar-2017	-6.6%	Jun-2015	-0.6%	May-2012	+8.9%	Oct-2008	+1.0%
Nov-2020	-6.2%	Ago-2013	-0.6%	Nov-2016	+8.5%	Ene-2008	+1.0%
Jul-2018	-6.1%	Nov-2013	-0.6%	Jun-2024	+8.1%	Ene-2009	+1.0%

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

## Portafolio Benchmark

100.0% Dólar Spot

## Principales riesgos

Tasas: Bajo (bonos corto plazo)  
Crédito: Bajo (guber y chequeras)  
Cambios: Exposición al Dólar

## El fondo en números

### Activos netos

\$348.5 millones de Pesos

### Resumen Rendimientos:

Junio	8.11	8.15	-0.03
YTD	8.07	7.75	+0.32
12 meses	6.85	6.05	+0.80
Histórico*	2.93	1.45	+1.48

\* Datos de diciembre 2007 a junio 2024.

### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	2.96%
Error de rastreo:	0.07%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	1.0141 -0.0005

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.23%	2.15%
Consumo de VaR		57%

## Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1FI):	0.92%
Administración:	0.27%
Distribución:	0.65%

### Como encontrar el fondo:

ISIN	MX51VA2N0060
Ticker	VALMX30 B1FI

### Operación del fondo:

Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 08:00 a 13:00

\* 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	Benchmark	Portafolio
Efectivo / Fondeo	-	100.0%
Distribución por sector (deuda y capitales)		
Efectivo / Fondeo		100.0%
Distribución por región (incluye deuda y capitales)		
Norte-América		94.4%
América Latina		5.6%
Principales 10 tenencias		
Saldo Efectivo Dólares		94.4%
Saldo Efectivo Pesos		5.6%
<b>Total</b>		<b>100.0%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	2
Diversificación (1/Herfindahl)	1

## Portafolio por monedas

Pesos	5.6%
UDIs	-
Dólares (EUA)	94.4%
Euros	-

## Información adicional

## Posibles adquirentes (sub series):

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

## Clasificación y Autorización CNBV:

Fondo de inversión especializado en Deuda denominada en Dólares. Oficio No. 157/90511/2019 con fecha 26 de julio del 2019.

## 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. / Calificadora: HR Ratings

## 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 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](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