

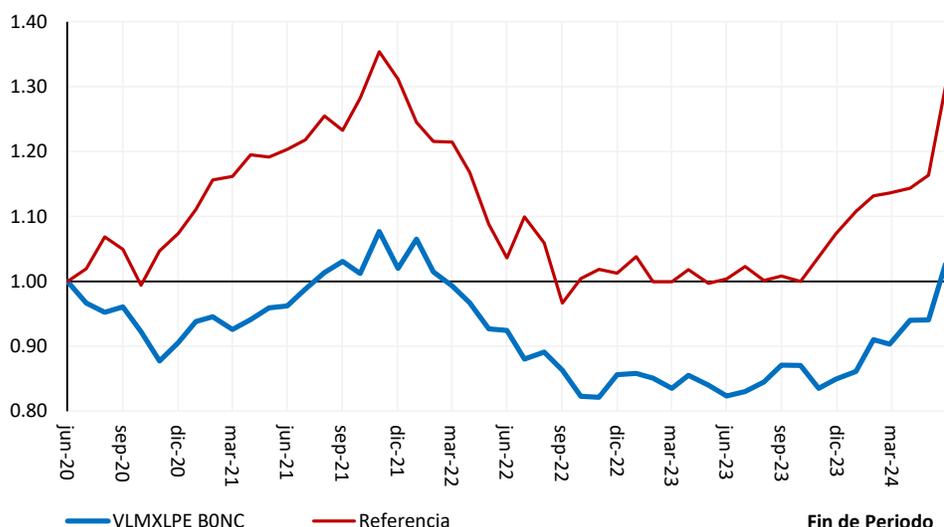


Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es ofrecer al público inversionista, rendimientos en el largo plazo, con base en un modelo de asignación óptima de recursos, aprovechando los posibles instrumentos de inversión de renta variable o de deuda, tanto nacionales y extranjeros. Para tales efectos, el fondo realiza inversiones de manera directa en los diferentes instrumentos y/o a través de trackers listados en el SIC y en las bolsas de valores, en valores listados en MILA y/o fondos de inversión tanto de renta variable como de deuda nacionales y extranjeros.

Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Junio	Mayo	Abril	YTD	3 meses	6 meses
VLMXLPE B0NC	9.11	0.03	4.11	20.78	13.62	20.78
Referencia	11.67	1.75	0.66	21.04	14.38	21.04
Diferencia	-2.57	-1.73	+3.45	-0.26	-0.76	-0.26

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VLMXLPE B0NC	24.59	2.17				0.65
Referencia	29.43	2.59				6.77
Diferencia	-4.84	-0.41				-6.12

* Datos de jun-20 a jun-24 de ser necesario se reconstruye la serie B0NC 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-2021	-5.3%	Jul-2022	-10.9%	Jun-2024	+9.1%	Ene-2022	+9.5%
Nov-2020	-4.9%	Nov-2020	-10.2%	Nov-2021	+6.4%	Sep-2022	+5.7%
Jul-2022	-4.8%	Oct-2022	-8.6%	Feb-2024	+5.7%	Ago-2022	+4.8%
Feb-2022	-4.8%	Nov-2023	-7.8%	Ene-2022	+4.4%	Dic-2022	+4.8%
Oct-2022	-4.7%	Ago-2020	-6.3%	Dic-2022	+4.2%	Jun-2022	+4.5%

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

Información al 28 junio 2024

Portafolio de referencia

100.0% iShares MSCI All Country World

Principales riesgos

Cambios: Exposición a monedas

Capitales: Exposición a mercados globales

El fondo en números

Activos netos

\$2,745 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

Junio	9.11	11.67	-2.57
YTD	20.78	21.04	-0.26
12 meses	24.59	29.43	-4.84
Histórico*	0.65	6.77	-6.12

* Datos de junio 2020 a junio 2024.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	3.44%
Error de rastreo:	4.16%
Beta (β) / Alfa (α)	0.4302 0.0019

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.09%	4.75%
Consumo de VaR		23%

Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B0NC):	0.18%
Administración:	0.18%
Distribución:	-

Como encontrar el fondo:

ISIN	¿Fondo?
Ticker	VLMXLPE B0NC

Operación del fondo:

Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 07:30 a 10:30

* 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%	89.2%
Deuda Pesos	-	9.5%
Efectivo / Fondeo	-	1.3%
Distribución por sector (deuda y capitales)		
Multi-Sectorial		89.2%
Gobierno Federal		9.5%
Efectivo / Fondeo		1.3%
Distribución por región (incluye deuda y capitales)		
Multi-región		89.2%
América Latina		10.8%
Distribución por plazo (solo deuda)		
0-3 meses	-	1.3%
20-30 años	-	9.5%
Total deuda (duración bonos en directo 10.8% = 8.5 años)	-	10.8%
Distribución por calificación (solo deuda)		
Fondeo diario		1.3%
Gobierno Federal		9.5%
Total deuda		10.8%
Principales 10 tenencias		
Fondo de Inversión HMC RV Global (HMCRGE)		88.3%
Bonos de Desarrollo (Jul-53 @ 8.00)		9.5%
Saldo Efectivo Pesos		1.3%
Vanguard FTSE All-World UCITS ETF (VWRA)		0.8%
Saldo Efectivo Dólares		-
Total		100.0%

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación

Número de emisoras	5
Diversificación (1/Herfindahl)	1

Portafolio por monedas

Pesos	10.8%
UDIs	-
Dólares (EUA)	89.2%
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 Activos con asignación discrecional. Oficio No. 157/9792/2020 de fecha 12 de mayo 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