



## 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).

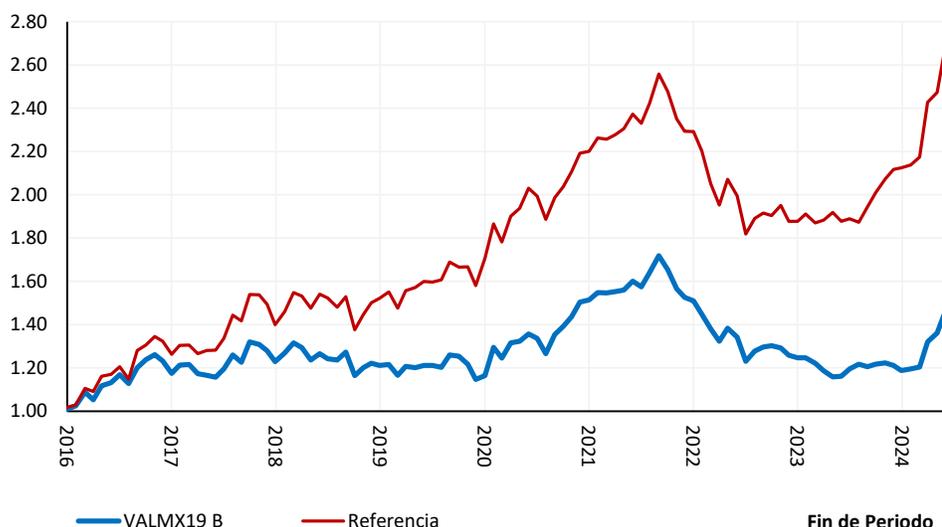
Información al 30 agosto 2024

### 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

\$8,304 millones de Pesos

#### Resumen Rendimientos:

	7.74	9.04	-1.30
Agosto	7.74	9.04	-1.30
YTD	20.38	34.17	-13.79
12 meses	26.29	43.60	-17.31
Histórico*	4.60	12.38	-7.77

\* Datos de febrero 2016 a agosto 2024.

#### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	3.68%
Error de rastreo:	1.87%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	1.0214 0.0062

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

VaR (4) y límite de VaR:	0.98%	5.75%
Consumo de VaR	17%	

### Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Agosto	Julio	Junio	YTD	3 meses	6 meses
VALMX19 B	7.74	3.06	9.69	20.38	21.79	21.07
Referencia	9.04	1.89	11.64	34.17	24.02	27.38
Diferencia	-1.30	+1.17	-1.94	-13.79	-2.23	-6.31

### Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX19 B	26.29	-2.89	3.90	3.44		4.60
Referencia	43.60	4.34	11.00	11.22		12.38
Diferencia	-17.31	-7.23	-7.11	-7.78		-7.77

\* Datos de feb-16 a ago-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):

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%	Ago-2024	+7.7%	Ago-2023	+2.4%
Ene-2022	-5.3%	Jul-2023	-4.2%	Dic-2017	+7.7%	Mar-2018	+2.3%
Oct-2020	-5.3%	Jun-2023	-3.6%	Nov-2020	+7.0%	Sep-2023	+2.3%

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



## Portafolio

Información al 30 agosto 2024

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Deuda Moneda Extranjera	-	73.2%
Capitales Globales	100.0%	25.3%
Efectivo / Fondo	-	1.4%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Financieros	24.4%
Multi-Sectorial	16.1%
Gobierno Federal	13.0%
Efectivo / Fondo	1.4%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	30.5%
Euro Zona	24.4%
América Latina	0.0%

Distribución por plazo (solo deuda)	
Fondo / Tracker	73.2%
0-3 meses	1.4%
<b>Total deuda (duración bonos en directo 1.4% = 0.0 años)</b>	<b>74.7%</b>

Distribución por calificación (solo deuda)	
Tracker / Fondo	60.2%
Fondeo diario	1.4%
Gobierno Federal	13.0%
<b>Total deuda</b>	<b>74.7%</b>

Principales 10 tenencias	
Valmex - Deuda Global (VLMXDME)	45.1%
iShares Treasury Bond 7-10 year UCITS (CBU0)	11.6%
Invesco US Treasury Bond 3-7 Years Ucits ETF ACC (TR7A)	11.4%
Vanguard USD Corporate Bond UCITS ETF (VDPA)	10.0%
iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF USD (IMBA)	7.9%
iShares \$ Short Duration Corp Bond UCITS (SDIA)	7.3%
iShares \$ TIPS UCITS ETF USD (IDTP)	3.0%
Saldo Efectivo Dólares	1.4%
iShares Short Treasury Bond UCITS (IB01)	1.4%
Vangard US Treasury 0-1 Bond UCITS ETF (USD) Accumulating (VDS)	1.0%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	11
Diversificación (1/Herfindahl)	4

## Portafolio por monedas

Pesos	45.1%
UDIs	-
Dólares (EUA)	54.9%
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](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 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](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