



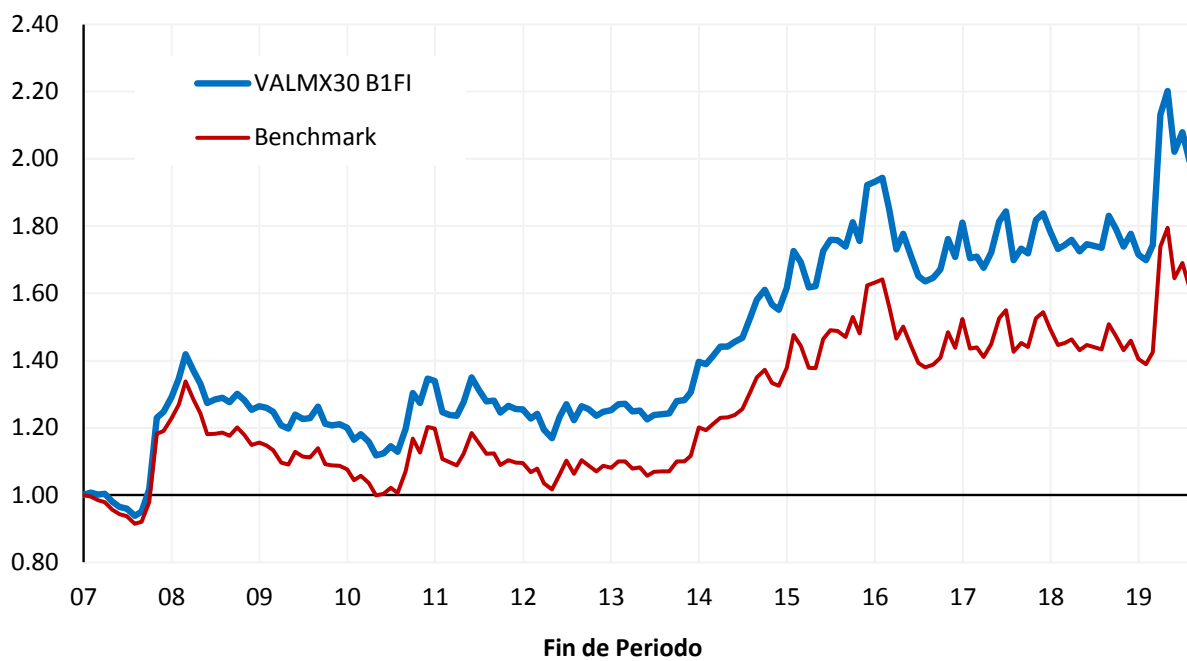
**Descripción del Fondo**

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 31 agosto 2020

**Rendimientos (1)**

**Valor teórico de \$1 Peso**



**Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)**

	Agosto	Julio	Junio	YTD	3 meses	6 meses
<b>VALMX30 B1FI</b>	0.49	-4.20	2.87	16.76	-0.96	14.78
<b>Benchmark</b>	0.39	-4.33	2.75	15.55	-1.31	13.85
<b>Diferencia</b>	+0.10	+0.14	+0.12	+1.20	+0.35	+0.93

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
<b>VALMX30 B1FI</b>	9.39	6.75	4.83	6.78	4.71	5.63
<b>Benchmark</b>	7.65	5.36	3.75	5.66	3.61	3.90
<b>Diferencia</b>	+1.75	+1.39	+1.09	+1.12	+1.10	+1.74

\* Datos de dic-07 a ago-20 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	-8.2%	Nov-2011	-1.0%	Mar-2020	+22.2%	Oct-2011	+1.2%
Jul-2018	-7.8%	Jun-2013	-0.9%	Oct-2008	+21.0%	Ene-2008	+1.2%
Ene-2012	-6.9%	Jun-2015	-0.7%	Nov-2016	+9.5%	May-2013	+1.0%
Mar-2017	-6.4%	Dic-2014	-0.6%	Sep-2011	+8.9%	Ene-2009	+0.9%
Ene-2018	-5.9%	Nov-2013	-0.5%	Sep-2008	+7.0%	Dic-2013	+0.9%

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: Alto (Dólares)

**El fondo en números**

**Activos netos**

\$572.4 millones de Pesos

**Resumen Rendimientos:**

Agosto	0.49	0.39	+0.10
YTD	16.76	15.55	+1.20
12 meses	9.39	7.65	+1.75
Histórico*	5.63	3.90	+1.74

\* Datos de diciembre 2007 a agosto 2020.

**Datos estadísticos (2):**

Volatilidad:	5.15%
Error de rastreo:	0.11%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0003 -0.0011

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.93%	2.75%
Consumo de VaR	70%	

**Algunos datos prácticos**

<b>Comisiones anuales (serie B1FI):</b>	<b>0.92%</b>
Administración:	0.27%
Distribución:	0.65%

**Como encontrar el fondo:**

ISIN	MXP800621007
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 31 agosto 2020

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		98.8%
América Latina		1.2%
Principales 10 tenencias		
Saldo Efectivo Dólares		98.8%
Saldo Efectivo Pesos		1.2%
<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	1.2%
UDIs	-
Dólares (EUA)	98.8%
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 Deuda denominada en Dólares. Oficio No. 157/90511/2019 de fecha 26 de julio de 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

Legaria 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