



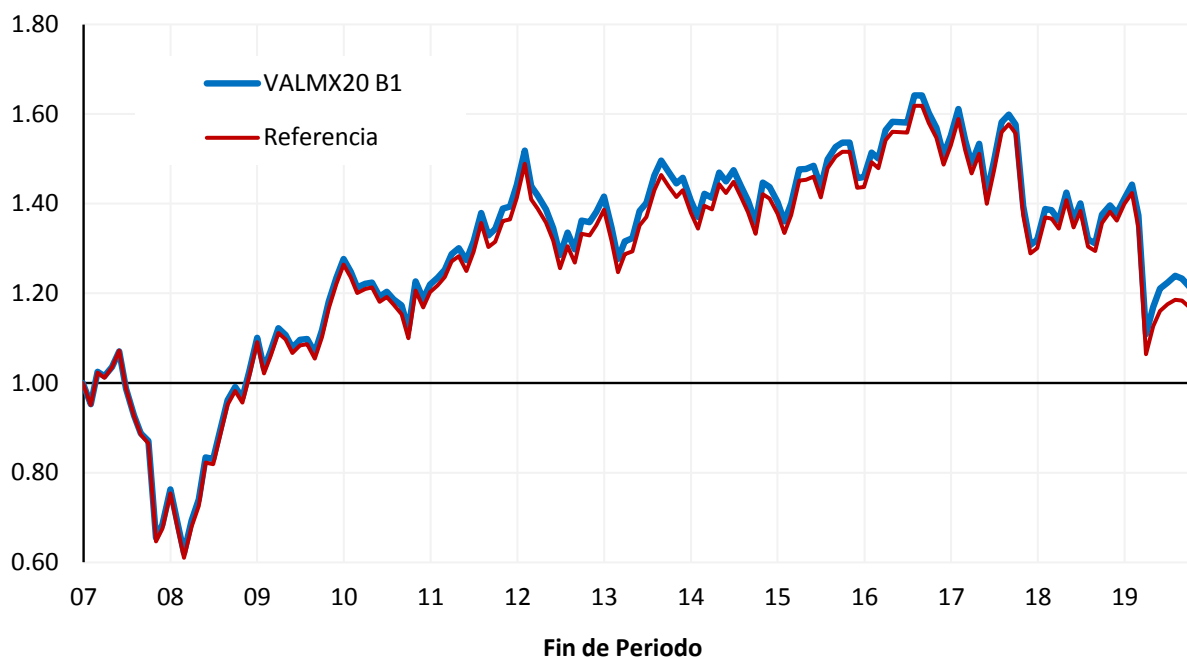
**Descripción del Fondo**

El fondo tiene como objetivo ofrecer al público inversionista una alternativa de inversión cuya estrategia busque superar el rendimiento del S&P/BMV Índice de Precios y Cotizaciones de la Bolsa Mexicana de Valores (BMV).

Información al 30 octubre 2020

**Rendimientos (1)**

Valor teórico de \$1 Peso



**Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)**

	Octubre	Septiembre	Agosto	YTD	3 meses	6 meses
<b>VALMX20 B1</b>	-0.22	-1.49	-0.52	-14.13	-2.22	3.62
<b>Referencia</b>	0.32	-1.29	-0.14	-16.22	-1.12	4.03
<b>Diferencia</b>	-0.54	-0.20	-0.37	+2.09	-1.10	-0.41

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
<b>VALMX20 B1</b>	-13.21	-8.26	-3.49	-1.63	0.25	1.51
<b>Referencia</b>	-15.17	-8.82	-3.77	-1.78	0.04	1.25
<b>Diferencia</b>	+1.96	+0.56	+0.29	+0.15	+0.21	+0.26

\* Datos de dic-07 a oct-20 de ser necesario se reconstruye la serie B1 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	
Oct-2008	-24.8%	May-2009	-0.6%	May-2009	+12.7%	Mar-2020	+1.7%
Mar-2020	-19.3%	Oct-2020	-0.5%	Mar-2009	+11.6%	Feb-2020	+0.7%
Oct-2018	-11.6%	Abr-2020	-0.5%	Dic-2008	+11.5%	Ago-2011	+0.6%
Ene-2009	-10.0%	Ago-2020	-0.4%	Oct-2011	+9.7%	May-2020	+0.5%
Feb-2009	-9.5%	Dic-2019	-0.4%	Jul-2009	+8.4%	Oct-2008	+0.5%

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

**Portafolio de referencia**

100.0% S&P/BMV IRT

**Principales riesgos**

Capitales: Exposición al mercado de México

**El fondo en números**

**Activos netos**

\$170.1 millones de Pesos

**Resumen Rendimientos:**

Octubre	-0.22	0.32	-0.54
YTD	-14.13	-16.22	+2.09
12 meses	-13.21	-15.17	+1.96
Histórico*	1.51	1.25	+0.26

\* Datos de diciembre 2007 a octubre 2020.

**Datos estadísticos (2):**

Volatilidad:	5.19%
Error de rastreo:	0.38%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0432 -0.0001

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

VaR (4) y límite de VaR:	3.20%	3.61%
Consumo de VaR		88%

**Algunos datos prácticos**

**Comisiones anuales (serie B1): 2.13%**

Administración: 0.38%

Distribución: 1.75%

**Como encontrar el fondo:**

ISIN MXP800541007

Ticker VALMX20 B1

**Operación del fondo:**

Liquidez (compra) Diaria

Liquidez (venta) Diaria

Plazo liquidación 48 Horas

Horario operación \* De 08:30 a 14:30

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



## Portafolio

Información al 30 octubre 2020

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales México	100.0%	97.6%
Efectivo / Fondo	-	2.4%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Consumo frecuente	30.3%
Materiales	18.6%
Comunicaciones	18.2%
Financieros	11.9%
Industrial	11.4%
Salud	3.6%
Consumo no básico	3.6%
Efectivo / Fondo	2.4%

Principales 10 tenencias	
América Móvil (AMX)	15.6%
Wal-Mart de México (WALMEX)	12.2%
Grupo Financiero Banorte (GFNORTE)	10.1%
Fomento Económico Mexicano (FEMSA)	9.2%
Grupo México (GMEXICO)	8.1%
Cementos Mexicanos (CEMEX)	4.2%
Genoma Lab International (LAB)	3.6%
Grupo Elektra (ELEKTRA)	3.0%
Grupo Aeroportuario del Pacífico (GAP)	2.9%
Grupo Televisa (TLEVISA)	2.7%
<b>Total</b>	<b>71.7%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	32
Diversificación (1/Herfindahl)	13

## Portafolio por monedas

Pesos	100.0%
UDIs	-
Dólares (EUA)	-
Euros	-

## Información adicional

## Posibles adquirientes (sub series):

Personas Físicas, Personas morales, Personas no sujetas a retención nacionales y/o extranjeras.

## Clasificación y Autorización CNBV:

Fondo de inversión especializado en Mercados accionarios en México. Oficio No. 157/90510/2019 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.

## 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