

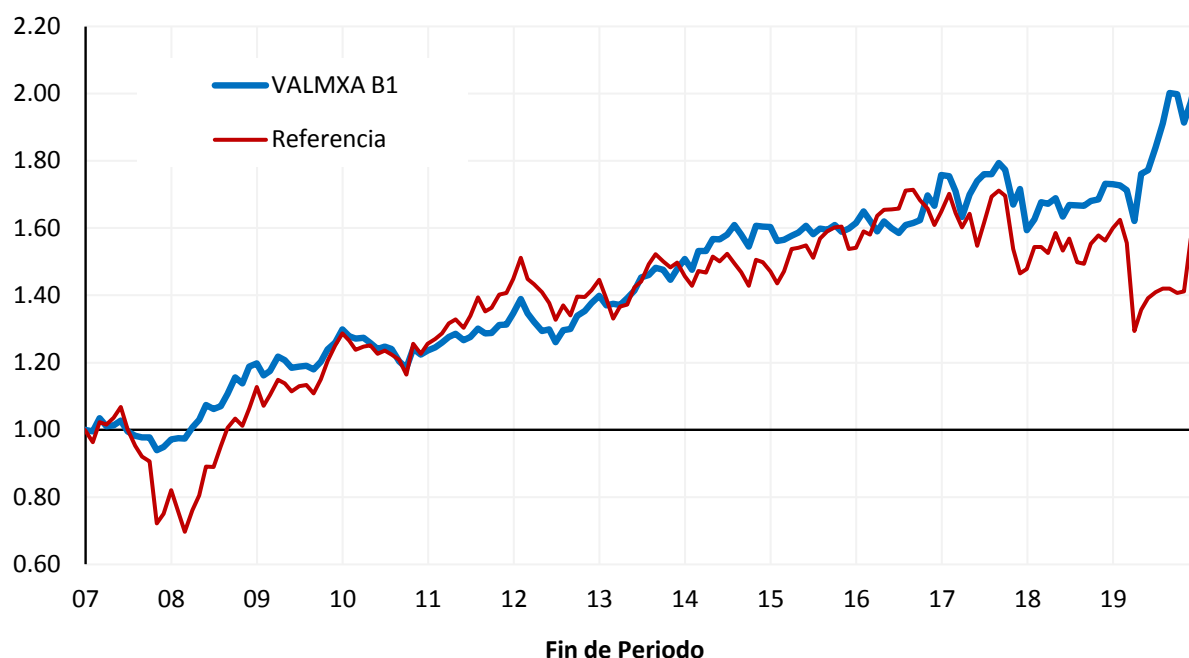


Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es ofrecer al público inversionista, rendimientos en el largo plazo, con base en un modelo de asignación óptima de activos, buscando las mejores oportunidades coyunturales a través de vehículos de inversión de capitales o de deuda, tanto nacionales como extranjeros. Corresponde a un nivel de inversionistas con un perfil de riesgo alto.

Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

| | Diciembre | Noviembre | Octubre | 2020 | 3 meses | 6 meses |
|-------------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|--------------|
| VALMXA B1 | 4.94 | 3.16 | -4.18 | 19.72 | 3.73 | 12.59 |
| Referencia | 4.35 | 11.12 | 0.36 | 2.36 | 16.37 | 16.20 |
| Diferencia | +0.59 | -7.96 | -4.54 | +17.36 | -12.64 | -3.61 |

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

| | 12 meses | 3 años | 5 años | 7 años | 10 años | Histórico* |
|-------------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| VALMXA B1 | 19.72 | 5.64 | 5.26 | 5.78 | 4.79 | 5.77 |
| Referencia | 2.36 | -0.22 | 2.16 | 1.79 | 2.44 | 3.87 |
| Diferencia | +17.36 | +5.87 | +3.10 | +3.99 | +2.35 | +1.90 |

* Datos de dic-07 a dic-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 | |
| Dic-2018 | -7.2% | Dic-2018 | -8.1% | Abr-2020 | +8.7% | Oct-2008 | +16.5% |
| Oct-2018 | -5.9% | Nov-2020 | -8.0% | Dic-2017 | +5.5% | Mar-2020 | +11.5% |
| Mar-2020 | -5.4% | Dic-2008 | -7.1% | Dic-2020 | +4.9% | Ene-2009 | +8.4% |
| Mar-2018 | -4.4% | May-2009 | -6.4% | Oct-2011 | +4.8% | May-2018 | +8.2% |
| Oct-2020 | -4.2% | Jul-2009 | -6.1% | Ago-2020 | +4.8% | Feb-2009 | +7.6% |

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

Información al 31 diciembre 2020

Portafolio de referencia

20.0% FTSE-PIPG-Cetes
80.0% S&P/BMV IRT

Principales riesgos

Tasas: Bajo a moderado
Inflación: Bajo
Crédito: Bajo (a través de fondos)
Cambios: Exposición a varias monedas
Capitales: Exposición a mercados globales

El fondo en números

Activos netos

\$371.0 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

| | | | |
|------------|--------------|-------------|---------------|
| Diciembre | 4.94 | 4.35 | +0.59 |
| 2020 | 19.72 | 2.36 | +17.36 |
| 12 meses | 19.72 | 2.36 | +17.36 |
| Histórico* | 5.77 | 3.87 | +1.90 |

* Datos de diciembre 2007 a diciembre 2020.

Datos estadísticos (2):

| | |
|--------------------------------------|------------------|
| Volatilidad: | 3.33% |
| Error de rastreo: | 4.19% |
| Beta (β) / Alfa (α) | 0.7432 / -0.0028 |

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

| | | |
|--------------------------|-------|-------|
| VaR (4) y límite de VaR: | 1.63% | 3.35% |
| Consumo de VaR | | 49% |

Algunos datos prácticos

| | |
|---------------------------------------|--------------|
| Comisiones anuales (serie B1): | 1.51% |
| Administración: | 0.36% |
| Distribución: | 1.15% |

Como encontrar el fondo:

| | |
|--------|--------------|
| ISIN | MX52VA2W0026 |
| Ticker | VALMXA B1 |

Operación del fondo:

| | |
|---------------------|------------------|
| Liquidez (compra) | Diaria |
| Liquidez (venta) | Diaria |
| Plazo liquidación | 48 Horas |
| Horario operación * | De 08:30 a 13:00 |

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



Portafolio

| Distribución por mercado | Referencia | Portafolio |
|--------------------------|------------|------------|
| Capitales Globales | - | 66.6% |
| Efectivo / Fondeo | - | 23.0% |
| Capitales México | 80.0% | 10.4% |

| Distribución por sector (deuda y capitales) | |
|---|-------|
| Multi-Sectorial | 27.3% |
| Efectivo / Fondeo | 23.0% |
| Salud | 15.5% |
| Tecnología | 10.8% |
| Industrial | 4.9% |
| Materiales | 4.4% |
| Consumo frecuente | 4.0% |

| Distribución por región (incluye deuda y capitales) | |
|---|-------|
| Norte-América | 62.4% |
| América Latina | 28.6% |
| Asia Emergente | 4.7% |
| Asia-Pacífico | 4.4% |

| Distribución por plazo (solo deuda) | | |
|---|--------------|--------------|
| 0-3 meses | - | 23.0% |
| 6-12 meses | 20.0% | - |
| Total deuda (duración bonos en directo 23.0% = 0.0 años) | 20.0% | 23.0% |

| Distribución por calificación (solo deuda) | |
|--|--------------|
| Fondeo diario | 23.0% |
| Gobierno Federal | - |
| Total deuda | 23.0% |

| Principales 10 tenencias | |
|---|--------------|
| Saldo Efectivo Pesos | 18.2% |
| Vanguard Information Technology (VGT) | 10.8% |
| Valmex - JP Morgan: US Technology (VLMXTEC) | 10.0% |
| iShares Global Clean Energy ETF (ICLN) | 9.7% |
| iShares Nasdaq Biotechnology (IBB) | 5.1% |
| Industrial Sector SPDR (XLI) | 4.9% |
| Saldo Efectivo Dólares | 4.9% |
| MSCI China Information Technology (CHIK) | 4.7% |
| Vanguard Small Cap (VB) | 4.4% |
| iShares MSCI All Country Asia ex Japan (AAXJ) | 4.4% |
| Total | 77.0% |

Información al 31 diciembre 2020

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación

| | |
|--------------------------------|----|
| Número de emisoras | 18 |
| Diversificación (1/Herfindahl) | 12 |

Portafolio por monedas

| | |
|---------------|-------|
| Pesos | 38.6% |
| UDIs | - |
| Dólares (EUA) | 61.4% |
| 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 Activos con asignación discrecional. Oficio No. 157/90496/2019 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

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 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. 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