



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).

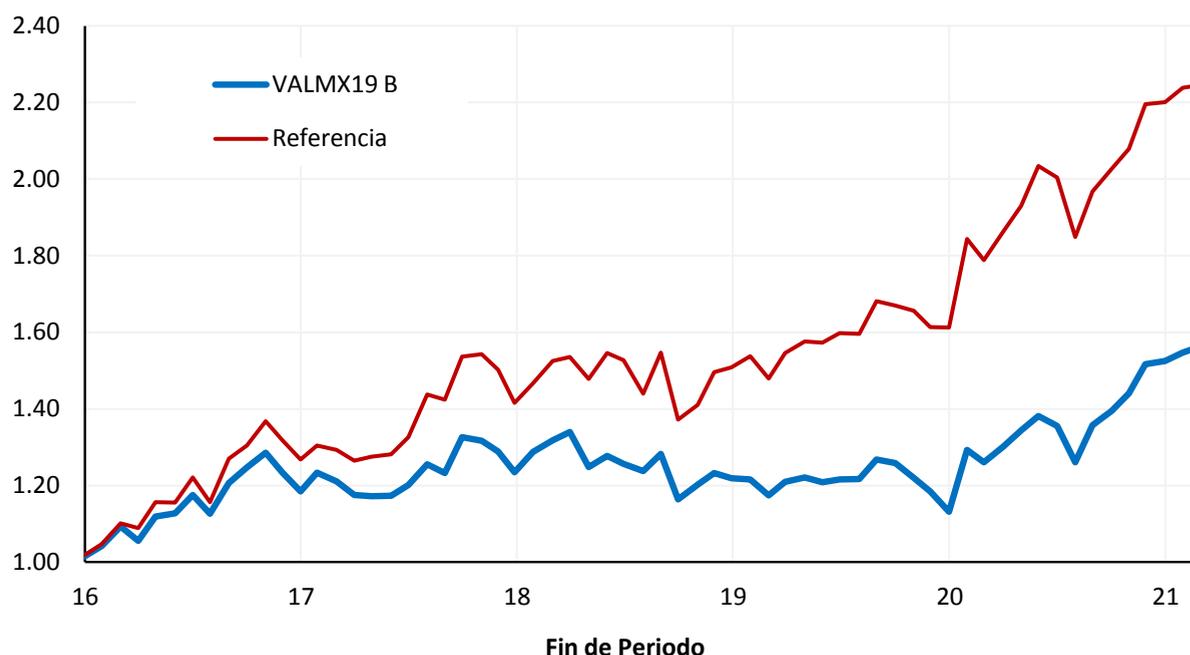
Información al 31 mayo 2021

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

\$9,101 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

Mayo	0.99	0.30	+0.68
YTD	11.96	10.76	+1.20
12 meses	23.92	25.54	-1.62
Histórico*	8.87	16.66	-7.79

* Datos de febrero 2016 a mayo 2021.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	4.29%
Error de rastreo:	1.72%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0063 0.0062

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.63%	14.00%
Consumo de VaR		12%

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Mayo	Abril	Marzo	YTD	3 meses	6 meses
VALMX19 B	0.99	1.44	0.57	11.96	3.03	15.07
Referencia	0.30	1.73	0.21	10.76	2.26	14.15
Diferencia	+0.68	-0.29	+0.36	+1.20	+0.77	+0.92

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX19 B	23.92	5.84	7.41			8.87
Referencia	25.54	13.75	15.31			16.66
Diferencia	-1.62	-7.91	-7.90			-7.79

* Datos de feb-16 a may-21 de ser necesario se reconstruye la serie B a partir de la serie del capital fijo "A".

Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B): 0.56%

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 08:30 a 14:00

Caídas mensuales más importantes

Retorno total	Retorno relativo
Dic-2018	-9.3%
Oct-2020	-7.0%
Jul-2018	-6.8%
Mar-2020	-4.4%
Oct-2016	-4.2%
Mar-2020	-4.4%
Feb-2019	-3.6%
Jul-2018	-3.1%
Mar-2020	-4.4%
Feb-2019	-3.6%
Jul-2018	-3.1%

Alzas mensuales más importantes

Retorno total	Retorno relativo
Abr-2020	+14.2%
Nov-2020	+7.7%
Dic-2017	+7.6%
Nov-2016	+7.2%
Jul-2016	+6.1%
Oct-2018	+4.2%
Dic-2018	+2.0%
Mar-2018	+1.6%
Nov-2020	+1.3%
Abr-2017	+1.2%

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

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



Portafolio

Información al 31 mayo 2021

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	100.0%	98.7%
Efectivo / Fondeo	-	1.3%
Distribución por sector (deuda y capitales)		
Multi-Sectorial		98.7%
Efectivo / Fondeo		1.3%
Distribución por región (incluye deuda y capitales)		
Multi-región		91.9%
Euro Zona		6.8%
Norte-América		0.8%
América Latina		0.5%
Principales 10 tenencias		
Valmex - Capitales Globales (VALMX28)		80.3%
Valmex - Brandes: Value Equities (VALMXVL)		11.6%
Valmex - EDM: Capitales España (VALMXES)		6.8%
Saldo Efectivo Dólares		0.8%
Saldo Efectivo Pesos		0.5%
Total		100.0%

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación

Número de emisoras	5
Diversificación (1/Herfindahl)	2

Portafolio por monedas

Pesos	99.2%
UDIs	-
Dólares (EUA)	0.8%
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 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

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