



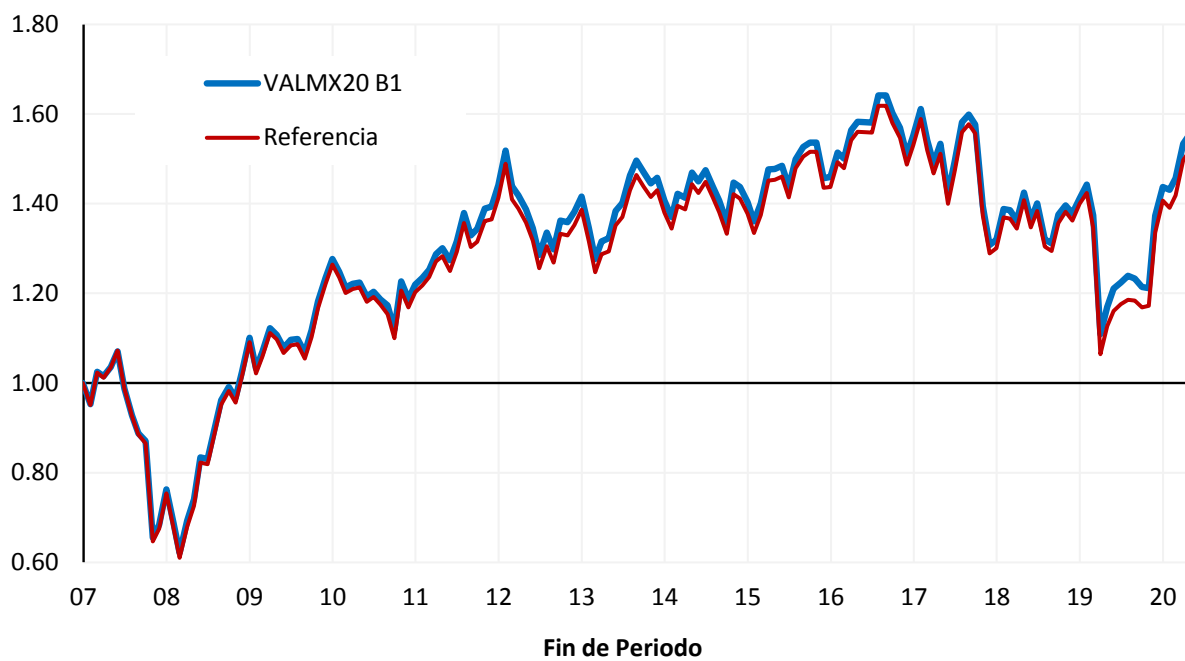
## Descripción del Fondo

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 31 mayo 2021

## Rendimientos (1)

### Valor teórico de \$1 Peso



### Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Mayo	Abril	Marzo	YTD	3 meses	6 meses
VALMX20 B1	3.05	1.43	5.28	11.51	10.03	16.75
Referencia	2.98	1.48	5.53	11.18	10.28	17.11
Diferencia	+0.07	-0.06	-0.25	+0.33	-0.25	-0.36

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX20 B1	32.38	4.08	1.54	2.13	3.00	3.58
Referencia	34.76	3.77	1.39	2.11	2.85	3.39
Diferencia	-2.38	+0.31	+0.16	+0.02	+0.15	+0.19

\* Datos de dic-07 a may-21 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%	Dic-2020	-0.6%	Nov-2020	+13.3%	Mar-2020	+1.7%
Mar-2020	-19.3%	Nov-2020	-0.6%	May-2009	+12.7%	Feb-2020	+0.7%
Oct-2018	-11.6%	May-2009	-0.6%	Mar-2009	+11.6%	Ene-2021	+0.7%
Ene-2009	-10.0%	Oct-2020	-0.5%	Dic-2008	+11.5%	Ago-2011	+0.6%
Feb-2009	-9.5%	Abr-2020	-0.5%	Oct-2011	+9.7%	May-2020	+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

\$181.5 millones de Pesos

#### Resumen Rendimientos:

Mayo	3.05	2.98	+0.07
YTD	11.51	11.18	+0.33
12 meses	32.38	34.76	-2.38
Histórico*	3.58	3.39	+0.19

\* Datos de diciembre 2007 a mayo 2021.

#### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	5.50%
Error de rastreo:	0.43%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	1.0502 -0.0003

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

VaR (4) y límite de VaR:	2.39%	2.57%
Consumo de VaR		93%

### Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1): 2.13%

Administración: 0.38%

Distribución: 1.75%

#### Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VA2O0000
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 31 mayo 2021

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales México	100.0%	97.4%
Efectivo / Fondo	-	2.6%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Consumo frecuente	27.1%
Materiales	22.9%
Comunicaciones	18.3%
Financieros	12.7%
Industrial	8.7%
Salud	3.9%
Consumo no básico	3.8%
Efectivo / Fondo	2.6%

Principales 10 tenencias	
América Móvil (AMX)	14.1%
Grupo Financiero Banorte (GFNORTE)	11.0%
Wal-Mart de México (WALMEX)	10.4%
Fomento Económico Mexicano (FEMSA)	9.9%
Grupo México (GMEXICO)	9.5%
Cementos Mexicanos (CEMEX)	8.1%
Grupo Televisa (TLEVISA)	4.2%
Genoma Lab International (LAB)	3.9%
Grupo Elektra (ELEKTRA)	3.0%
Saldo Efectivo Pesos	2.6%
<b>Total</b>	<b>76.7%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	30
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. 157/13036/2021 con fecha 26 de febrero del 2021

## 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