



**Descripción del Fondo**

Información al 30 junio 2021

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).

**Portafolio Benchmark**

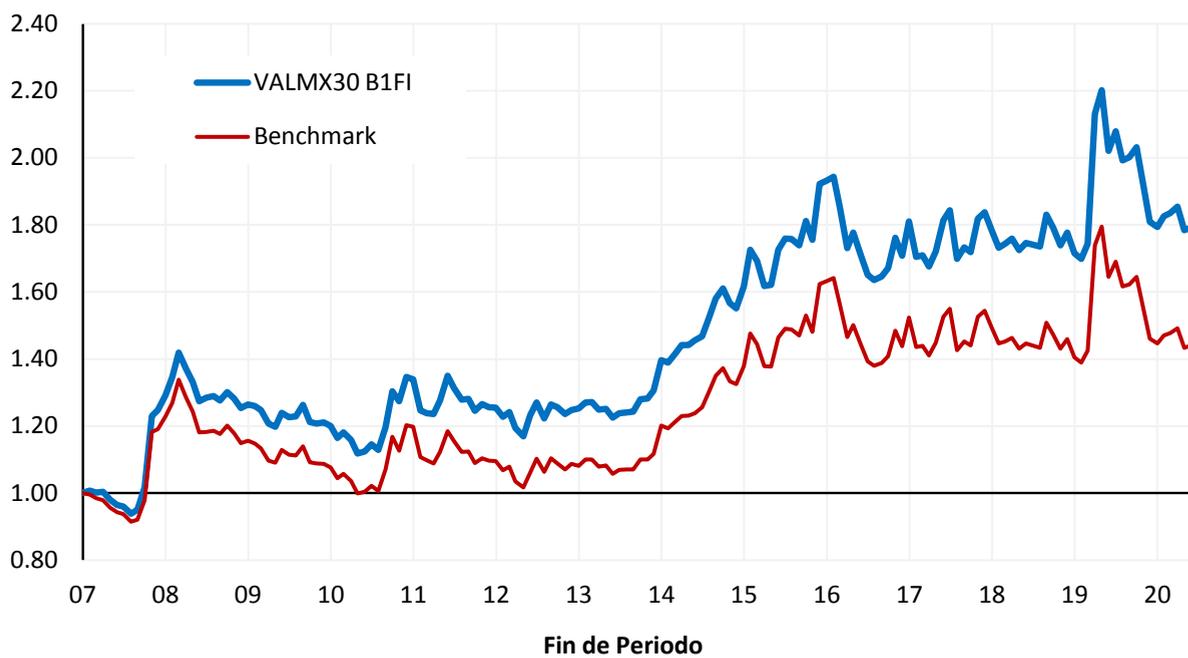
100.0% Dólar Spot

**Rendimientos (1)**

**Principales riesgos**

Tasas: Bajo (bonos corto plazo)  
Crédito: Bajo (guber y chequeras)  
Cambios: Exposición al Dólar

**Valor teórico de \$1 Peso**



**El fondo en números**

**Activos netos**

\$649.4 millones de Pesos

**Resumen Rendimientos:**

Junio	-1.06	-1.08	+0.02
YTD	-1.08	-1.48	+0.40
12 meses	-14.69	-15.70	+1.01
Histórico*	4.34	2.66	+1.68

\* Datos de diciembre 2007 a junio 2021.

**Datos estadísticos (2):**

Volatilidad:	5.01%
Error de rastreo:	0.10%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0000 -0.0013

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.56%	2.34%
Consumo de VaR		67%

**Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)**

	Junio	Mayo	Abril	YTD	3 meses	6 meses
VALMX30 B1FI	-1.06	0.50	-3.77	-1.08	-4.31	-1.08
Benchmark	-1.08	0.43	-3.85	-1.48	-4.48	-1.48
Diferencia	+0.02	+0.08	+0.08	+0.40	+0.18	+0.40

**Algunos datos prácticos**

**Comisiones anuales (serie B1FI): 0.92%**

Administración: 0.27%  
Distribución: 0.65%

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX30 B1FI	-14.69	-1.27	0.17	5.27	4.48	4.34
Benchmark	-15.70	-2.77	-0.90	4.17	3.38	2.66
Diferencia	+1.01	+1.50	+1.07	+1.09	+1.10	+1.68

\* Datos de dic-07 a jun-21 de ser necesario se reconstruye la serie B1FI a partir de la serie del capital fijo "A".

**Como encontrar el fondo:**

ISIN: MX51VA2N0060  
Ticker: VALMX30 B1FI

**Caídas mensuales más importantes**

	Retorno total	Retorno relativo
May-2020	-8.2%	Nov-2011 -1.0%
Jul-2018	-7.8%	Jun-2013 -0.9%
Ene-2012	-6.9%	Jun-2015 -0.7%
Mar-2017	-6.4%	Dic-2014 -0.6%
Ene-2018	-5.9%	Nov-2013 -0.5%

**Alzas mensuales más importantes**

	Retorno total	Retorno relativo
Mar-2020	+22.2%	Oct-2011 +1.2%
Oct-2008	+21.0%	Ene-2008 +1.2%
Nov-2016	+9.5%	May-2013 +1.0%
Sep-2011	+8.9%	Ene-2009 +0.9%
Sep-2008	+7.0%	Dic-2013 +0.9%

**Operación del fondo:**

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

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 30 junio 2021

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		99.4%
América Latina		0.6%
Principales 10 tenencias		
Saldo Efectivo Dólares		99.4%
Saldo Efectivo Pesos		0.6%
<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	0.6%
UDIs	-
Dólares (EUA)	99.4%
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 con fecha 26 de julio del 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