



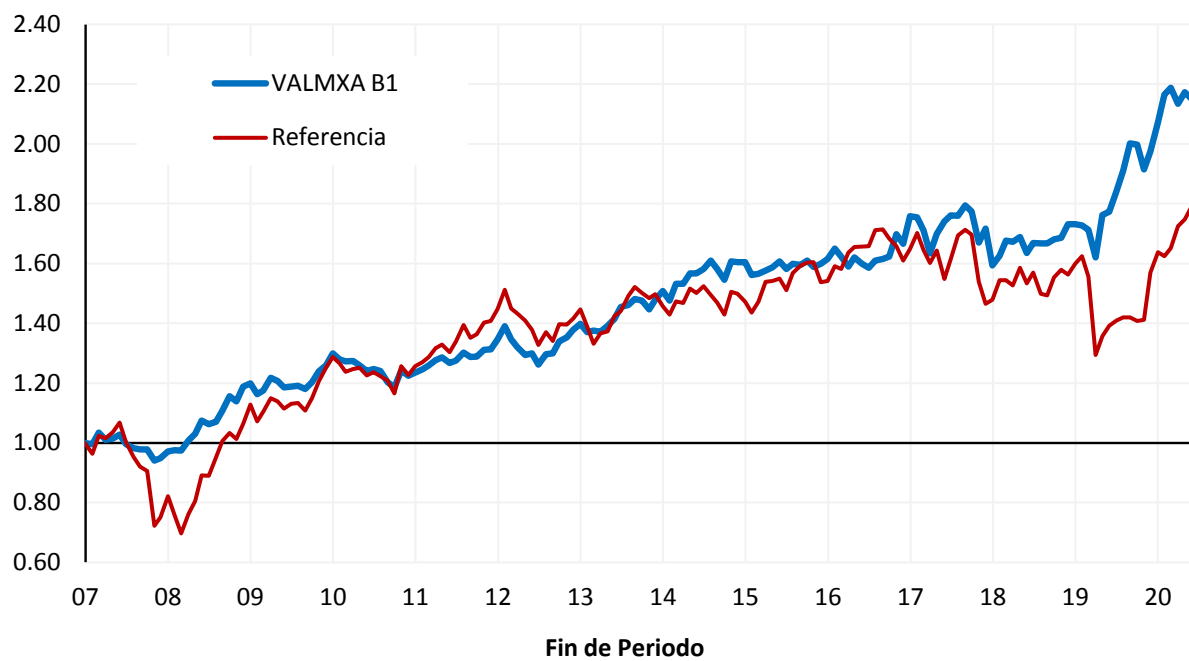
**Descripción del Fondo**

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.

Información al 30 junio 2021

**Rendimientos (1)**

**Valor teórico de \$1 Peso**



**Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)**

	Junio	Mayo	Abril	YTD	3 meses	6 meses
<b>VALMXA B1</b>	1.33	-1.01	1.79	5.16	2.10	5.16
<b>Referencia</b>	1.05	2.46	1.28	10.46	4.86	10.46
<b>Diferencia</b>	+0.28	-3.47	+0.51	-5.30	-2.76	-5.30

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
<b>VALMXA B1</b>	18.40	7.37	6.62	5.96	5.74	5.94
<b>Referencia</b>	28.36	3.84	3.66	3.30	3.88	4.49
<b>Diferencia</b>	-9.96	+3.52	+2.96	+2.66	+1.86	+1.45

\* Datos de dic-07 a jun-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	
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%	Mar-2021	-6.9%	Oct-2011	+4.8%	May-2018	+8.2%
Oct-2020	-4.2%	May-2009	-6.4%	Ago-2020	+4.8%	Feb-2009	+7.6%

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

**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**

\$434.6 millones de Pesos

**Resumen Rendimientos:**

Junio	1.33	1.05	+0.28
YTD	5.16	10.46	-5.30
12 meses	18.40	28.36	-9.96
Histórico*	5.94	4.49	+1.45

\* Datos de diciembre 2007 a junio 2021.

**Datos estadísticos (2):**

Volatilidad:	3.23%
Error de rastreo:	4.18%
Beta (β) / Alfa (α)	0.6787 -0.0002

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

VaR (4) y límite de VaR:	0.95%	3.35%
Consumo de VaR		28%

**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

Información al 30 junio 2021

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	-	67.3%
Efectivo / Fondeo	-	19.9%
Capitales México	80.0%	12.8%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Multi-Sectorial	20.5%
Efectivo / Fondeo	19.9%
Salud	12.1%
Industrial	8.3%
Consumo no básico	6.6%
Financieros	6.2%
Tecnología	5.4%
Materiales	4.6%
Consumo frecuente	4.2%
Comunicaciones	2.0%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	62.5%
América Latina	27.6%
Euro Zona	5.0%
Asia-Pacífico	4.9%

Distribución por plazo (solo deuda)		
0-3 meses	-	19.9%
6-12 meses	20.0%	-
<b>Total deuda (duración bonos en directo 19.9% = 0.0 años)</b>	<b>20.0%</b>	<b>19.9%</b>

Distribución por calificación (solo deuda)	
Fondeo diario	19.9%
Gobierno Federal	-
<b>Total deuda</b>	<b>19.9%</b>

Principales 10 tenencias	
Saldo Efectivo Pesos	14.8%
Valmex - JP Morgan: US Technology (VLMXTEC)	10.2%
Industrial Sector SPDR (XLI)	8.3%
Vanguard Consumer Discretionary (VCR)	6.6%
Financial Sector SPDR (XLF)	6.2%
iShares Global Clean Energy ETF (ICLN)	5.5%
Vanguard Information Technology (VGT)	5.4%
Vanguard Small Cap (VB)	5.2%
iShares US Medical Devices (IHI)	5.2%
Saldo Efectivo Dólares	5.1%
<b>Total</b>	<b>72.5%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	19
Diversificación (1/Herfindahl)	14

## Portafolio por monedas

Pesos	37.9%
UDIs	-
Dólares (EUA)	62.1%
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 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.

## 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