



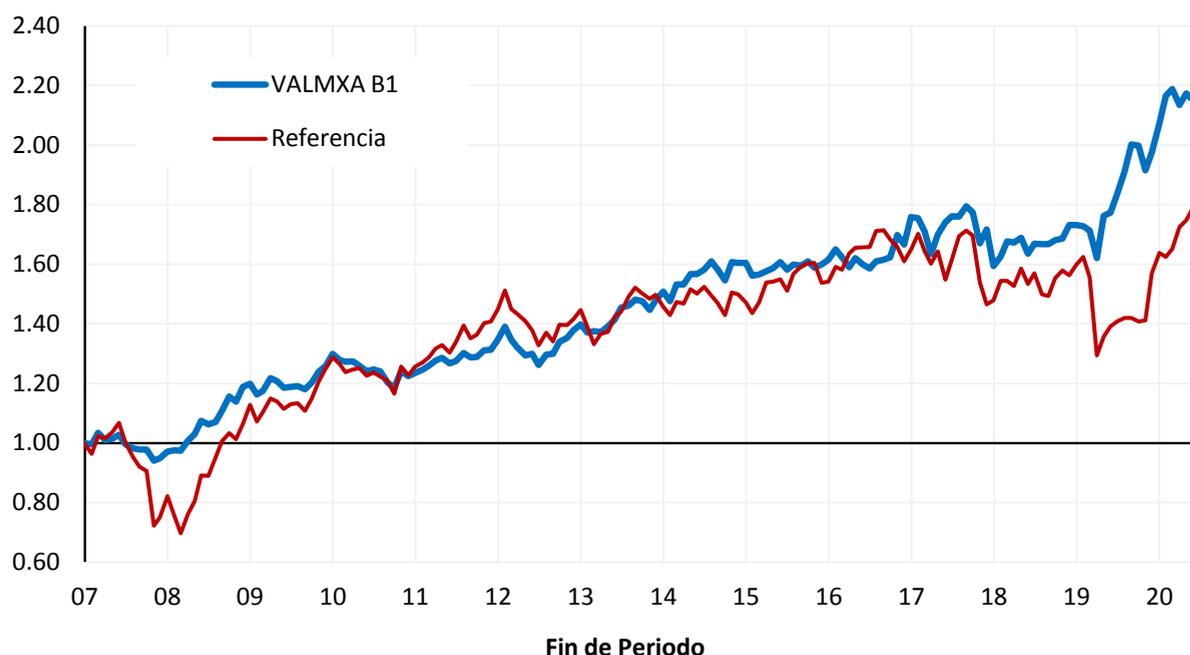
Descripción del Fondo

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
VALMXA B1	1.33	-1.01	1.79	5.16	2.10	5.16
Referencia	1.05	2.46	1.28	10.46	4.86	10.46
Diferencia	+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*
VALMXA B1	18.40	7.37	6.62	5.96	5.74	5.94
Referencia	28.36	3.84	3.66	3.30	3.88	4.49
Diferencia	-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%	-
Total deuda (duración bonos en directo 19.9% = 0.0 años)	20.0%	19.9%

Distribución por calificación (solo deuda)	
Fondeo diario	19.9%
Gobierno Federal	-
Total deuda	19.9%

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%
Total	72.5%

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

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