



**Descripción del Fondo**

Información al 30 junio 2021

Es un fondo cuyo objetivo es invertir los recursos captados del público inversionista en acciones de empresas españolas o cuya actividad preponderante sea en España, y que se encuentren listadas en el SIC (Sistema Internacional de Cotizaciones). El fondo es asesorado por EDM, en Barcelona España, y basado en su fondo EDM Spanish Equities". EDM es un destacado gestor independiente.

**Portafolio de referencia**

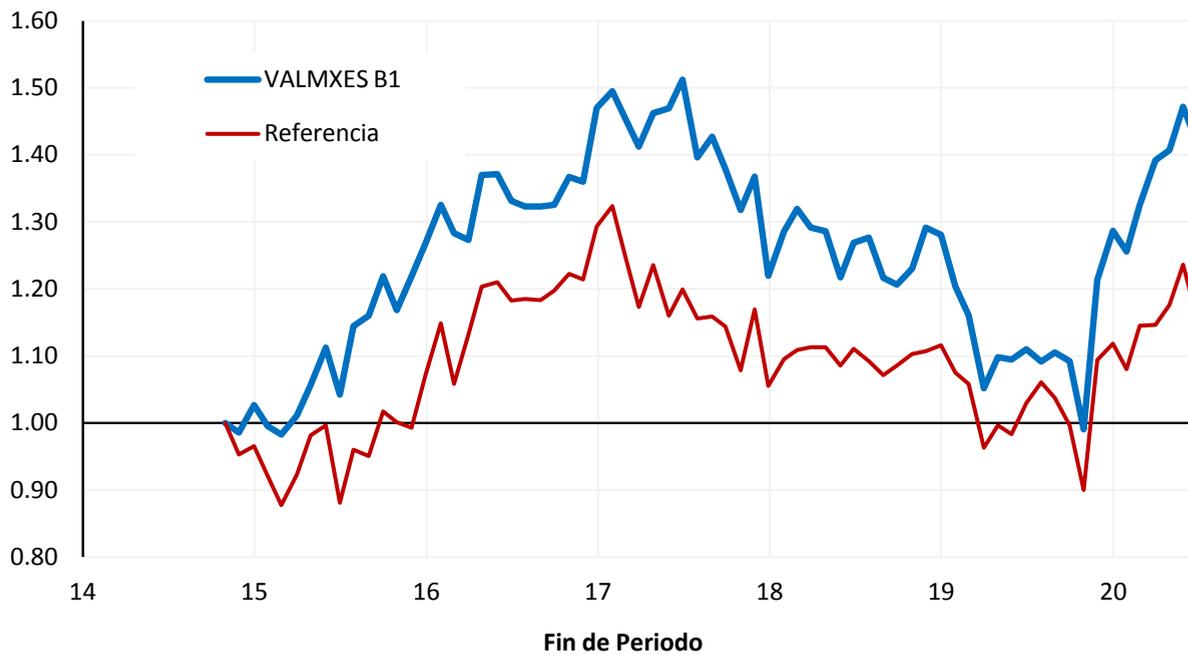
100.0% iShares MSCI Spain

**Rendimientos (1)**

**Principales riesgos**

Cambios: Exposición al Euro  
Capitales: Exposición a mercados globales

**Valor teórico de \$1 Peso**



**El fondo en números**

**Activos netos**

\$646.2 millones de Pesos

**Resumen Rendimientos:**

Junio	-3.87	-6.79	+2.92
YTD	9.93	3.03	+6.90
12 meses	27.42	11.91	+15.51
Histórico*	6.32	2.54	+3.78

\* Datos de octubre 2015 a junio 2021.

**Datos estadísticos (2):**

Volatilidad:	6.00%
Error de rastreo:	2.56%
Beta (β) / Alfa (α)	0.8489 / 0.0005

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

VaR (4) y límite de VaR:	2.03%	2.72%
Consumo de VaR	74%	

**Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)**

	Junio	Mayo	Abril	YTD	3 meses	6 meses
VALMXES B1	-3.87	4.63	1.05	9.93	1.64	9.93
Referencia	-6.79	5.12	2.60	3.03	0.53	3.03
Diferencia	+2.92	-0.49	-1.55	+6.90	+1.11	+6.90

**Algunos datos prácticos**

**Comisiones anuales (serie B1):** 2.03%

Administración: 1.18%  
Distribución: 0.85%

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMXES B1	27.42	-2.19	6.31			6.32
Referencia	11.91	-1.32	5.51			2.54
Diferencia	+15.51	-0.87	+0.79			+3.78

\* Datos de oct-15 a jun-21 de ser necesario se reconstruye la serie B1 a partir de la serie del capital fijo "A".

**Como encontrar el fondo:**

ISIN: MX52VA190028  
Ticker: VALMXES B1

**Caídas mensuales más importantes**

Retorno total	Retorno relativo
Dic-2018 -10.8%	Mar-2017 -7.8%
Mar-2020 -9.4%	Jul-2020 -4.7%
Oct-2020 -9.3%	Nov-2018 -4.7%
Jul-2018 -7.7%	Jul-2018 -4.0%
Jun-2016 -6.3%	Dic-2016 -3.9%

**Alzas mensuales más importantes**

Retorno total	Retorno relativo
Nov-2020 +22.5%	May-2018 +6.6%
Jul-2016 +9.8%	Jun-2016 +5.2%
Dic-2017 +8.1%	Nov-2016 +5.1%
Abr-2017 +7.6%	Mar-2021 +4.9%
Dic-2020 +6.0%	Feb-2017 +4.7%

**Operación del fondo:**

Liquidez (compra): Diaria  
Liquidez (venta): Diaria  
Plazo liquidación: 48 Horas  
Horario operación \*: De 08:30 a 09:30

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	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	100.0%	99.0%
Efectivo / Fondeo	-	1.0%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Industrial	29.2%
Consumo no básico	15.6%
Salud	12.3%
Financieros	10.5%
Materiales	6.7%
Energía	6.5%
Servicios públicos	5.6%
Comunicaciones	5.0%
Tecnología	4.6%
Consumo frecuente	3.1%
Efectivo / Fondeo	1.0%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Euro Zona	95.8%
Multi-región	3.1%
América Latina	1.0%

Principales 10 tenencias	
Grifols (GRFP)	7.9%
Grupo Catalana Occidente (GCO)	7.6%
Contrucciones y Auxiliar de Ferrocarriles (CAFE)	6.9%
Repsol (REPS)	6.5%
Gestamp Automoción (GEST)	5.6%
CIE Automotive (CIEA)	5.1%
Industria de Diseño Textil (ITX)	4.9%
Cia Distribución Integral Logista (LOG)	4.8%
Global Dominion (DOM)	4.6%
Laboratorios Farmaceuticos ROVI (ROVI)	4.4%
<b>Total</b>	<b>58.2%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	24
Diversificación (1/Herfindahl)	21

## Portafolio por monedas

Pesos	1.0%
UDIs	-
Dólares (EUA)	2.6%
Euros	96.4%

## Información adicional

## Posibles adquirientes (sub series):

Personas físicas, Personas morales y personas no sujetas a retención nacionales y/o extranjeras.

## Clasificación y Autorización CNBV:

Fondo de inversión especializado en Mercados accionarios globales. Oficio No. 157/9790/2020 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](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