



Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es invertir los recursos captados del público inversionista en Acciones y otros vehículos de inversión colectiva como ETF's (Exchange Traded Funds) y Fondos de Inversión, de los mercados de capitales y de deuda nacionales e internacionales, desarrollados y emergentes, listados en el SIC (Sistema Internacional de Cotizaciones). El fondo busca preservar el capital en el largo plazo a través de la diversificación a lo largo de sectores y regiones, buscando aquellos que ofrecen mayor potencial de crecimiento, pero con menor riesgo.

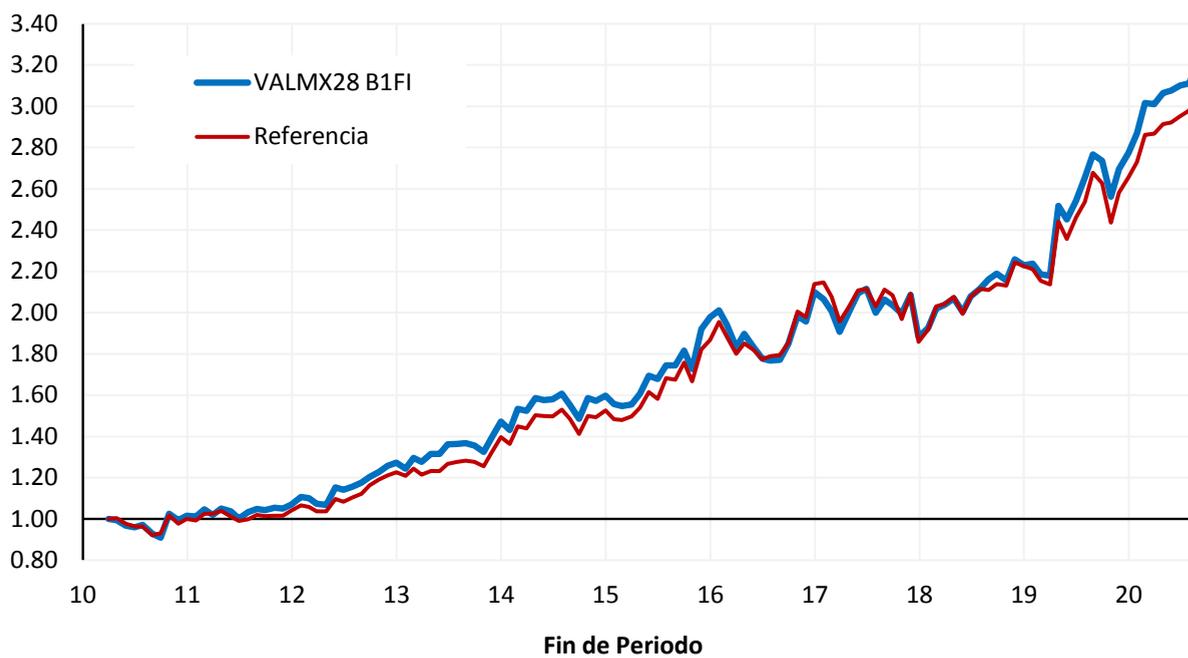
Información al 31 agosto 2021

Portafolio de referencia

100.0% MSCI ACWI Index (net)

Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Principales riesgos

Cambios: Exposición a varias monedas
 Capitales: Exposición a mercados globales

El fondo en números

Activos netos

\$24,574 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

Agosto	3.39	3.24	+0.15
YTD	15.93	15.79	+0.14
12 meses	16.21	14.90	+1.31
Histórico*	11.87	11.39	+0.48

* Datos de marzo 2011 a agosto 2021.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	4.09%
Error de rastreo:	1.05%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0605 -0.0025

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.14%	4.50%
Consumo de VaR		25%

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Agosto	Julio	Junio	YTD	3 meses	6 meses
VALMX28 B1FI	3.39	0.30	0.83	15.93	4.56	6.60
Referencia	3.24	0.93	1.05	15.79	5.29	7.51
Diferencia	+0.15	-0.62	-0.23	+0.14	-0.73	-0.91

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX28 B1FI	16.21	15.96	13.02	13.00	13.23	11.87
Referencia	14.90	13.37	12.93	13.33	12.81	11.39
Diferencia	+1.31	+2.59	+0.09	-0.32	+0.42	+0.48

* Datos de mar-11 a ago-21 de ser necesario se reconstruye la serie B1FI a partir de la serie del capital fijo "A".

Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1FI):	0.53%
Administración:	0.10%
Distribución:	0.43%

Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VA130016
Ticker	VALMX28 B1FI

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.

Caídas mensuales más importantes

Retorno total	Retorno relativo
Dic-2018 -9.8%	Ene-2017 -3.0%
Oct-2020 -6.3%	Sep-2011 -2.9%
Mar-2017 -5.6%	Mar-2012 -2.6%
Jul-2018 -5.5%	Jul-2016 -2.5%
Mar-2018 -4.9%	Ene-2018 -2.1%

Alzas mensuales más importantes

Retorno total	Retorno relativo
Abr-2020 +15.5%	Oct-2018 +3.6%
Oct-2011 +12.7%	Oct-2011 +3.3%
Nov-2016 +11.1%	Ago-2019 +2.5%
May-2013 +7.8%	May-2013 +2.2%
Oct-2017 +7.3%	Jul-2012 +2.2%

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



Portafolio

Información al 31 agosto 2021

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	100.0%	95.9%
Fondo Mixto	-	2.6%
Efectivo / Fondeo	-	1.5%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Multi-Sectorial	56.2%
Financieros	12.3%
Salud	5.6%
Industrial	4.2%
Consumo no básico	2.7%
Servicios públicos	2.2%
Efectivo / Fondeo	1.5%
Energía	1.2%
Materiales	0.8%
Consumo frecuente	0.5%
Tecnología	0.4%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	61.7%
Multi-región	25.5%
Euro Zona	5.3%
Asia-Pacífico	4.0%
Asia Emergente	2.2%
Europa	1.0%
América Latina	0.2%

Principales 10 tenencias	
Valmex - JP Morgan: US Technology (VLMXTEC)	12.4%
Valmex - Brandes: Value Equities (VALMXVL)	5.9%
Vanguard Dividend Appreciation (VIG)	5.5%
iShares Edge MSCI USA Quality Factor ETF (QUAL)	4.8%
Vanguard Emerging Markets Stock (VWO)	4.2%
Vanguard Value (VTV)	4.2%
iShares Edge MSCI Intl Quality Factor ETF (IQLT)	4.1%
iShares US Medical Devices (IHI)	3.9%
Financial Sector SPDR (XLF)	3.3%
Industrial Select Sector UCITS (SXXL)	2.9%
Total	51.2%

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación

Número de emisoras	56
Diversificación (1/Herfindahl)	25

Portafolio por monedas

Pesos	21.2%
UDIs	-
Dólares (EUA)	78.3%
Euros	0.5%

Información adicional

Posibles adquirientes (sub series):

Personas físicas, Personas morales, Cajas y fondos de ahorro.

Clasificación y Autorización CNBV:

Fondo de inversión especializado en Mercados accionarios globales. Oficio No. 157/9803/2020 con fecha 12 de junio 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

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