



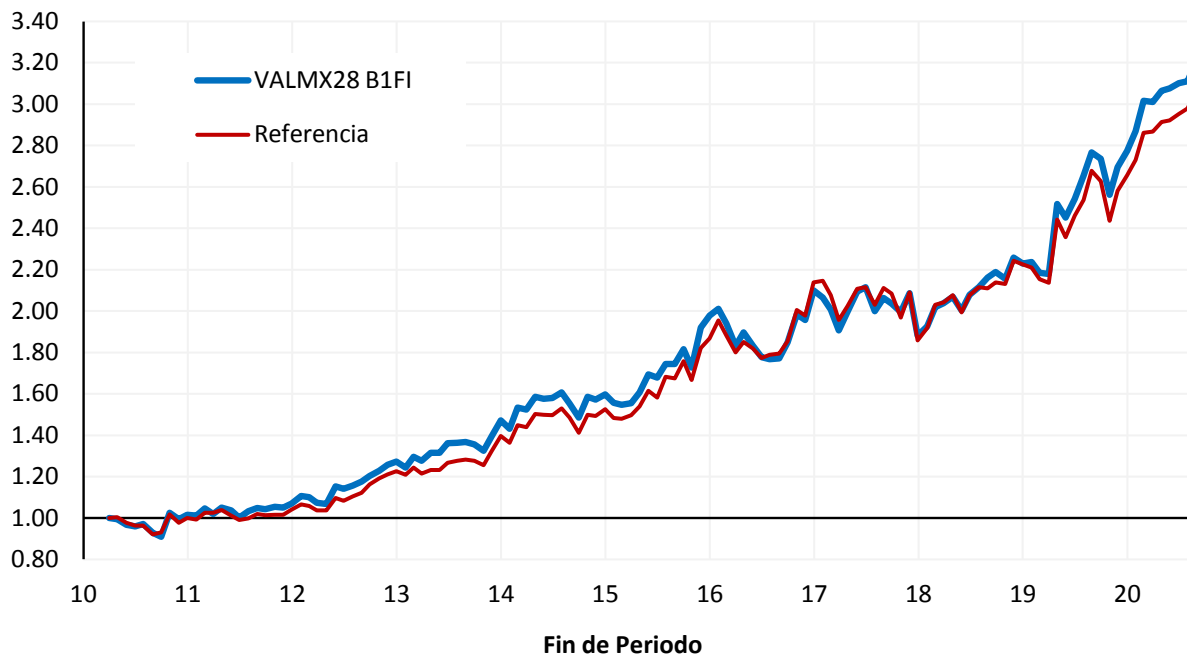
**Descripción del Fondo**

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

**Rendimientos (1)**

**Valor teórico de \$1 Peso**



**Portafolio de referencia**

100.0% MSCI ACWI Index (net)

**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	<b>3.39</b>	<b>3.24</b>	<b>+0.15</b>
YTD	<b>15.93</b>	<b>15.79</b>	<b>+0.14</b>
12 meses	<b>16.21</b>	<b>14.90</b>	<b>+1.31</b>
Histórico*	<b>11.87</b>	<b>11.39</b>	<b>+0.48</b>

\* 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
<b>VALMX28 B1FI</b>	<b>3.39</b>	<b>0.30</b>	<b>0.83</b>	<b>15.93</b>	<b>4.56</b>	<b>6.60</b>
<b>Referencia</b>	<b>3.24</b>	<b>0.93</b>	<b>1.05</b>	<b>15.79</b>	<b>5.29</b>	<b>7.51</b>
<b>Diferencia</b>	<b>+0.15</b>	<b>-0.62</b>	<b>-0.23</b>	<b>+0.14</b>	<b>-0.73</b>	<b>-0.91</b>

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

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

\* 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**

<b>Comisiones anuales (serie B1FI):</b>	<b>0.53%</b>
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 (SXL1)	2.9%
<b>Total</b>	<b>51.2%</b>

## 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](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