



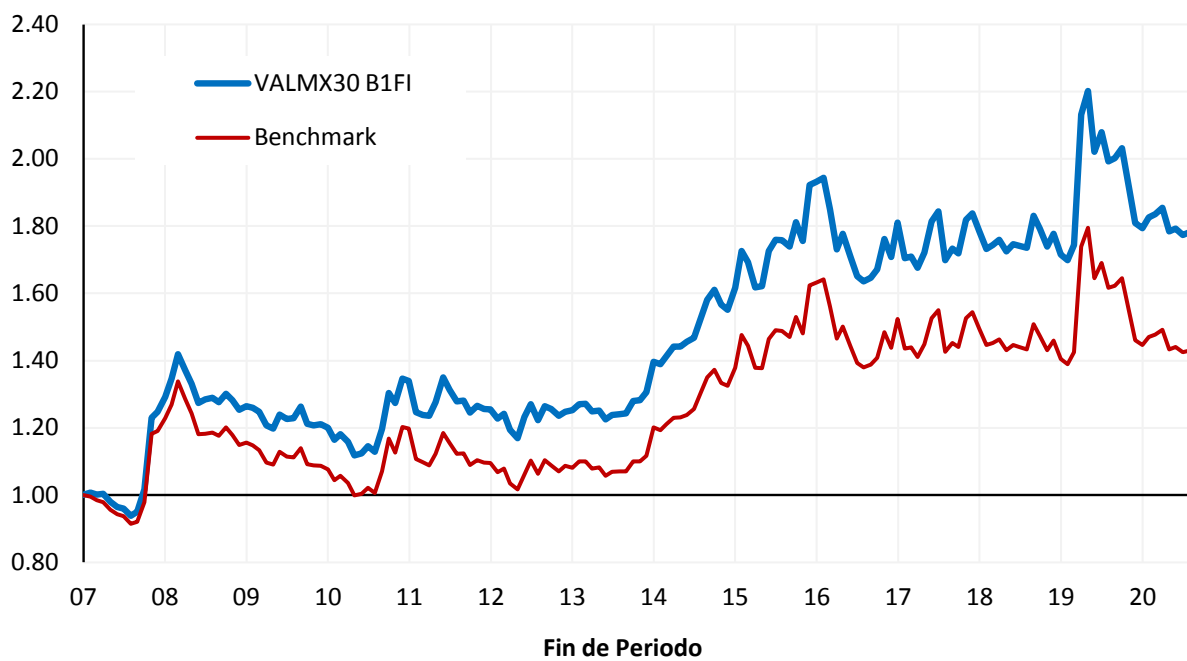
**Descripción del Fondo**

Es un fondo cuyo objetivo es ofrecer una alternativa de cobertura cambiaria respecto al Dólar americano. La inversión principal será en depósitos en chequera denominados en Dólares y en papeles gubernamentales de deuda denominados en Dólares americanos (Bonos UMS).

Información al 31 agosto 2021

**Rendimientos (1)**

**Valor teórico de \$1 Peso**



**Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)**

	Agosto	Julio	Junio	YTD	3 meses	6 meses
<b>VALMX30 B1FI</b>	1.29	0.41	-1.06	0.61	0.63	-1.67
<b>Benchmark</b>	1.20	0.33	-1.08	0.04	0.45	-2.08
<b>Diferencia</b>	+0.08	+0.08	+0.02	+0.57	+0.18	+0.41

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
<b>VALMX30 B1FI</b>	-9.88	1.35	0.74	5.47	4.19	4.41
<b>Benchmark</b>	-10.88	-0.12	-0.33	4.39	3.06	2.74
<b>Diferencia</b>	+0.99	+1.48	+1.06	+1.08	+1.14	+1.68

\* Datos de dic-07 a ago-21 de ser necesario se reconstruye la serie B1FI 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	
May-2020	-8.2%	Nov-2011	-1.0%	Mar-2020	+22.2%	Oct-2011	+1.2%
Jul-2018	-7.8%	Jun-2013	-0.9%	Oct-2008	+21.0%	Ene-2008	+1.2%
Ene-2012	-6.9%	Jun-2015	-0.7%	Nov-2016	+9.5%	May-2013	+1.0%
Mar-2017	-6.4%	Dic-2014	-0.6%	Sep-2011	+8.9%	Ene-2009	+0.9%
Ene-2018	-5.9%	Nov-2013	-0.5%	Sep-2008	+7.0%	Dic-2013	+0.9%

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

**Portafolio Benchmark**

100.0% Dólar Spot

**Principales riesgos**

Tasas: Bajo (bonos corto plazo)  
Crédito: Bajo (guber y chequeras)  
Cambios: Exposición al Dólar

**El fondo en números**

**Activos netos**

\$634.6 millones de Pesos

**Resumen Rendimientos:**

Agosto	1.29	1.20	+0.08
YTD	0.61	0.04	+0.57
12 meses	-9.88	-10.88	+0.99
Histórico*	4.41	2.74	+1.68

\* Datos de diciembre 2007 a agosto 2021.

**Datos estadísticos (2):**

Volatilidad:	4.82%
Error de rastreo:	0.10%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0003 -0.0012

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.49%	2.21%
Consumo de VaR		67%

**Algunos datos prácticos**

<b>Comisiones anuales (serie B1FI):</b>	<b>0.92%</b>
Administración:	0.27%
Distribución:	0.65%

**Como encontrar el fondo:**

ISIN	MX51VA2N0060
Ticker	VALMX30 B1FI

**Operación del fondo:**

Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 08:00 a 13:00

\* Los horarios pueden cambiar dependiendo de los días y horas hábiles en México, EE.UU. y en Europa.



## Portafolio

Información al 31 agosto 2021

Distribución por mercado	Benchmark	Portafolio
Efectivo / Fondeo	-	100.0%
Distribución por sector (deuda y capitales)		
Efectivo / Fondeo		100.0%
Distribución por región (incluye deuda y capitales)		
Norte-América		99.7%
América Latina		0.3%
Principales 10 tenencias		
Saldo Efectivo Dólares		99.7%
Saldo Efectivo Pesos		0.3%
<b>Total</b>		<b>100.0%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	2
Diversificación (1/Herfindahl)	1

## Portafolio por monedas

Pesos	0.3%
UDIs	-
Dólares (EUA)	99.7%
Euros	-

## Información adicional

## Posibles adquirientes (sub series):

Personas Físicas, Personas morales, No contribuyentes, Cajas y fondos de ahorro.

## Clasificación y Autorización CNBV:

Fondo de inversión especializado en Deuda denominada en Dólares. Oficio No. 157/90511/2019 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. / Calificadora: HR Ratings

## 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