

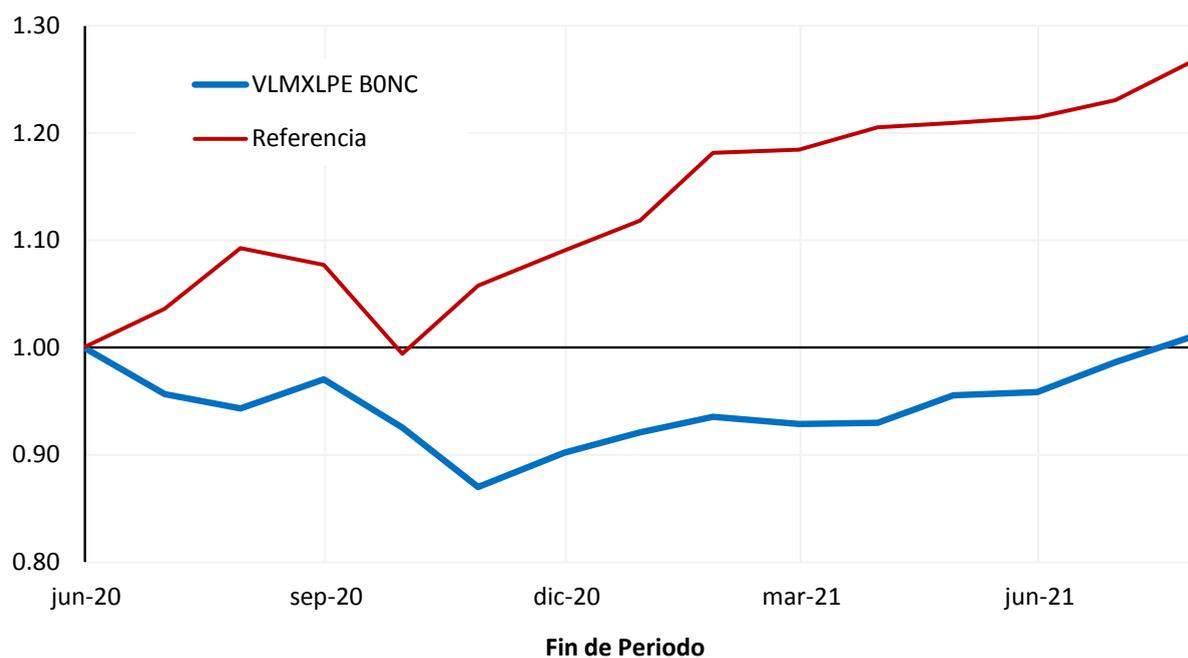


## Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es ofrecer al público inversionista, rendimientos en el largo plazo, con base en un modelo de asignación óptima de recursos, aprovechando los posibles instrumentos de inversión de renta variable o de deuda, tanto nacionales y extranjeros. Para tales efectos, el fondo realiza inversiones de manera directa en los diferentes instrumentos y/o a través de trackers listados en el SIC y en las bolsas de valores, en valores listados en MILA y/o fondos de inversión tanto de renta variable como de deuda nacionales y extranjeros.

## Rendimientos (1)

### Valor teórico de \$1 Peso



### Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Agosto	Julio	Junio	YTD	3 meses	6 meses
VLMXLPE B0NC	2.62	2.93	0.29	12.22	5.93	8.21
Referencia	3.19	1.31	0.43	16.46	5.00	7.47
Diferencia	-0.57	+1.61	-0.14	-4.24	+0.93	+0.74

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VLMXLPE B0NC	7.32					1.05
Referencia	16.23					22.74
Diferencia	-8.91					-21.68

\* Datos de jun-20 a ago-21 de ser necesario se reconstruye la serie B0NC a partir de la serie del capital fijo "A".

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

## Información al 31 agosto 2021

### Portafolio de referencia

100.0% iShares MSCI All Country World

### Principales riesgos

Cambios: Exposición a monedas

Capitales: Exposición a mercados globales

### El fondo en números

#### Activos netos

\$973.0 millones de Pesos

#### Resumen Rendimientos:

Agosto	2.62	3.19	-0.57
YTD	12.22	16.46	-4.24
12 meses	7.32	16.23	-8.91
Histórico*	1.05	22.74	-21.68

\* Datos de junio 2020 a agosto 2021.

#### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	3.17%
Error de rastreo:	4.67%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	0.0433 0.0178

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.13%	4.75%
Consumo de VaR		24%

### Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B0NC): 0.25%

Administración: 0.25%

Distribución: -

#### Como encontrar el fondo:

ISIN	¿Fondo?
Ticker	VLMXLPE B0NC

#### Operación del fondo:

Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 08:30 a 11:30

\* 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	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	100.0%	85.3%
Deuda Pesos	-	13.0%
Efectivo / Fondeo	-	1.7%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Multi-Sectorial	85.3%
Gobierno Federal	13.0%
Efectivo / Fondeo	1.7%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Multi-región	85.3%
América Latina	14.7%
Norte-América	0.0%

Distribución por plazo (solo deuda)	
0-3 meses	1.7%
20-30 años	13.0%
<b>Total deuda (duración bonos en directo 14.7% = 9.6 años)</b>	<b>14.7%</b>

Distribución por calificación (solo deuda)	
Fondeo diario	1.7%
Gobierno Federal	13.0%
<b>Total deuda</b>	<b>14.7%</b>

Principales 10 tenencias	
Fondo de Inversión HMC RV Global (HMCRGE)	72.0%
Vanguard FTSE All-World UCITS ETF (VWRA)	13.3%
Bonos de Desarrollo (Nov-47 @ 8.00)	13.0%
Saldo Efectivo Pesos	1.7%
Saldo Efectivo Dólares	0.0%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>

### Datos del portafolio

#### Emisoras y deversificación

Número de emisoras	5
Diversificación (1/Herfindahl)	2

#### Portafolio por monedas

Pesos	14.7%
UDIs	-
Dólares (EUA)	85.3%
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 Activos con asignación discrecional. Oficio No. 157/9792/2020 de fecha 12 de mayo 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