



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.

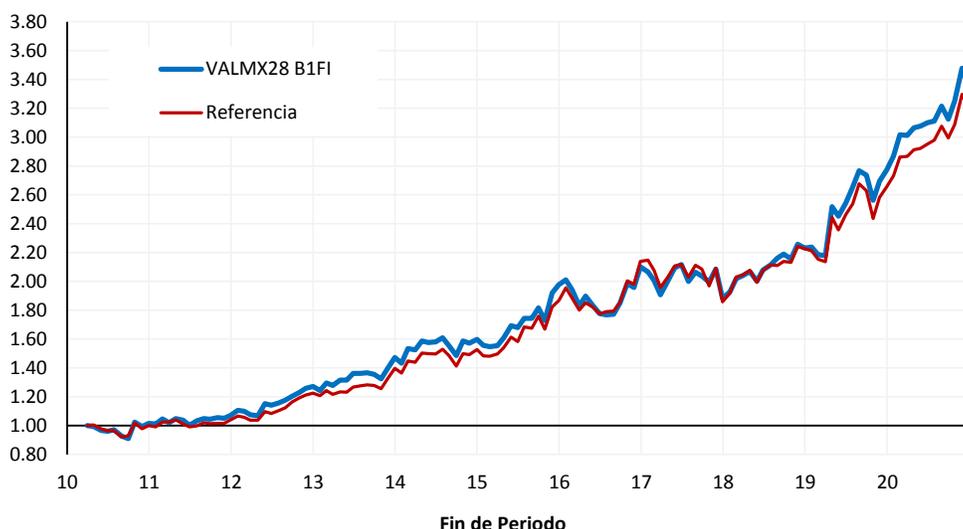
Información al 31 diciembre

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

\$25,322 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

Diciembre	-3.71	-2.77
2021	20.75	20.63
12 meses	20.75	20.63
Histórico*	11.90	11.44

* Datos de marzo 2011 a diciembre 2021.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:
 Error de rastreo:
 Beta (β) / Alfa (α) 0.9899

Valor en Riesgo (a 1 día el 97.5% de con

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

Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1FI):

Administración:
 Distribución:

Como encontrar el fondo:

ISIN MX52VA1300
 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 hábitos en México, EE.UU. y en Europa.

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Diciembre	Noviembre	Octubre	2021	3 meses	6 meses
VALMX28 B1FI	-3.71	7.04	4.03	20.75	7.23	8.01
Referencia	-2.77	6.79	3.05	20.63	7.00	8.55
Diferencia	-0.94	+0.25	+0.99	+0.13	+0.23	-0.53

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX28 B1FI	20.75	21.18	11.11	12.46	12.67	11.90
Referencia	20.63	19.91	11.40	12.60	12.35	11.44
Diferencia	+0.13	+1.27	-0.29	-0.14	+0.33	+0.46

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

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 diciembre

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	100.0%	95.9%
Fondo Mixto	-	2.6%
Efectivo / Fondo	-	1.6%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Multi-Sectorial	52.5%
Financieros	12.4%
Industrial	3.7%
Servicios públicos	3.6%
Salud	3.3%
Consumo no básico	3.0%
Efectivo / Fondo	1.6%
Materiales	0.8%
Energía	0.7%
Consumo frecuente	0.5%
Tecnología	0.4%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	62.7%
Multi-región	24.0%
Asia-Pacífico	3.8%
Euro Zona	3.1%
Asia Emergente	1.6%
Europa	1.0%
América Latina	0.1%

Principales 10 tenencias	
Valmex - JP Morgan: US Technology (VLMXTEC)	13.9%
Valmex - Brandes: Value Equities (VALMXVL)	6.0%
Vanguard Dividend Appreciation (VIG)	5.7%
iShares Edge MSCI USA Quality Factor ETF (QUAL)	4.9%
Vanguard Value (VTV)	4.3%
iShares Edge MSCI Intl Quality Factor ETF (IQLT)	4.0%
Vanguard Emerging Markets Stock (VWO)	3.9%
Utilities Sector SPDR (XLU)	3.6%
Valmex - Alliance Bernstein LP (VALMXHC)	3.6%
Financial Sector SPDR (XLF)	3.3%
Total	53.1%

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación

Número de emisoras

Diversificación (1/Herfindahl)

Portafolio por monedas

Pesos

UDIs

Dólares (EUA)

Euros

Información adicional

Posibles adquirientes (sub series):

Personas físicas, Personas morales, Cajas de ahorro.

Clasificación y Autorización CNBV:

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

Administración

Operador: Operadora Valmex de Fondos S.A de C.V. / Custodio: Valores Mexicanos S.A de C.V. / Proveedor de precios: Integral de Precios S.A de C.V.

Contactos

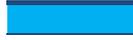
Legaria 549 Torre 2 Piso 7
 Colonia 10 de abril
 Alcaldía Miguel Hidalgo
 11250 Ciudad de México
 Teléfono (55) 5279-1200
www.valmex.com.mx

Notas: (1) Todos los rendimientos son netos de comisiones y gastos. (2) Los rendimientos menores a un año son tasas efectivas, los mayores a un año son tasas efectivas anualizadas. (3) Se emplean 36 meses de datos mensuales, con un mínimo de 12; la volatilidad mide la dispersión de los rendimientos, mientras que el beta mide la dispersión del rendimiento relativo a la referencia; finalmente, el alfa (α) mide el rendimiento sobre la referencia. (4) El VaR (Valor a Riesgo) mide la pérdida esperada, en 1 día, del fondo con un nivel de confianza, esta medida de riesgo se calcula con un horizonte histórico

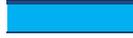
Declaración de responsabilidad: La información aquí contenida es únicamente con fines informativos y sin ningún tipo de validez oficial y/o legal, y no debe ser interpretada como una recomendación o invitación para comprar, vender o realizar otro tipo de operaciones con valor alguno. Los rendimientos 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 el prospecto de información al público inversionista para conocer 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



embre 2021



35



-0.94
+0.13
+0.13
+0.46

3.83%
0.82%
-0.0007

fianza):

4.50%
● 25%



0.53%
0.10%
0.43%

16

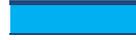
FI



3:00
os días y horas



embre 2021



53

22

26.2%

-

73.3%

0.5%



s y fondos de

ccionarios
de junio del

de Inversión
is Casa de
: Proveedor

omisiones,
s mayores a un
observaciones
vide la
error de rastreo
referencia; la
ornos con
vide el exceso de
(en Riesgo)
un 97.5% de
n modelo

oferta,
ismo
on su asesor