



## 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.

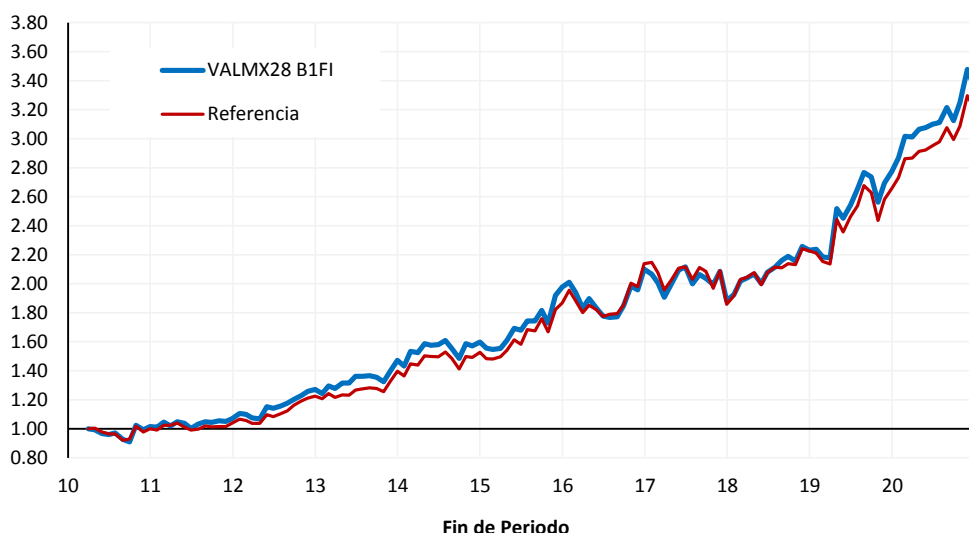
## Información al 31 diciembre

### 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 ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ ) 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%
<b>Total</b>	<b>53.1%</b>

### 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](http://www.valmex.com.mx)

**Notas:** (1) Todos los rendimientos son netos de comisiones y aquellos menores a un año son tasas efectivas, los mayores a un año son tasas efectivas anualizadas. (2) 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 ( $\alpha$ ) mide el rendimiento sobre la referencia. (3) El VaR (Valor a Riesgo) mide la pérdida esperada, en 1 día, del fondo on 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](http://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  
iide la  
error de rastreo  
ferencia; la  
rnos con  
iide el exceso de  
en Riesgo)  
un 97.5% de  
n modelo

oferta,  
ismo  
on su asesor