



## Descripción del Fondo

El fondo tiene como objetivo ofrecer al público inversionista una alternativa de inversión cuya estrategia busque superar el rendimiento del S&P/BMV Índice de Precios y Cotizaciones de la Bolsa Mexicana de Valores (BMV).

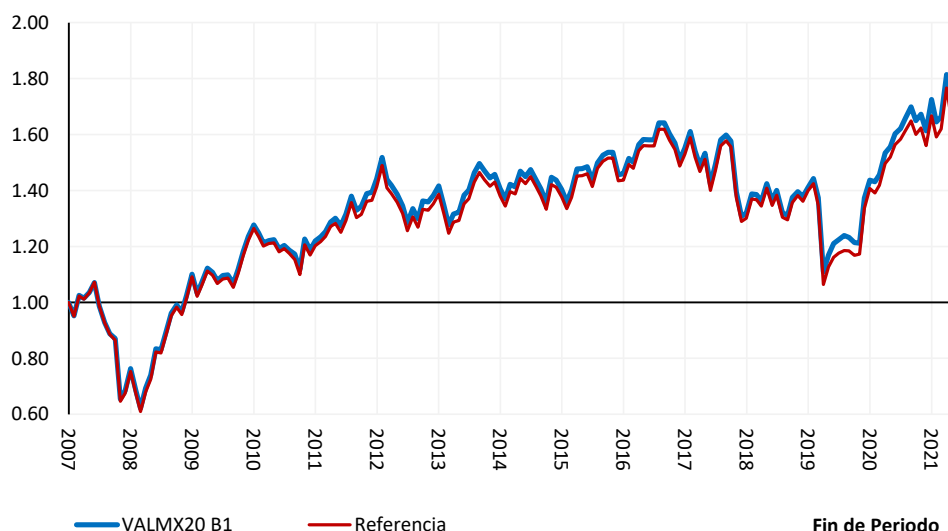
Información al 29 abril 2022

### Portafolio de referencia

100.0% S&P/BMV IRT

## Rendimientos (1)

### Valor teórico de \$1 Peso



### Principales riesgos

Capitales: Exposición al mercado de México

### El fondo en números

#### Activos netos

\$298.9 millones de Pesos

#### Resumen Rendimientos:

Abril	-6.45	-6.75	+0.30
YTD	-1.63	-1.15	-0.47
12 meses	9.12	8.44	+0.68
Histórico*	3.76	3.54	+0.22

\* Datos de diciembre 2007 a abril 2022.

#### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	5.34%
Error de rastreo:	0.46%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	1.0513 -0.0007

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.79%	2.10%
Consumo de VaR		85%

### Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Abril	Marzo	Febrero	YTD	3 meses	6 meses
VALMX20 B1	-6.45	9.11	1.07	-1.63	3.16	1.45
Referencia	-6.75	9.07	1.76	-1.15	3.50	1.45
Diferencia	+0.30	+0.03	-0.69	-0.47	-0.35	+0.00

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX20 B1	9.12	6.01	1.41	2.08	2.69	3.76
Referencia	8.44	5.37	1.09	1.91	2.53	3.54
Diferencia	+0.68	+0.63	+0.33	+0.18	+0.16	+0.22

\* Datos de dic-07 a abr-22 de ser necesario se reconstruye la serie B1 a partir de la serie del capital fijo "A".

### Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1):	2.13%
Administración:	0.38%
Distribución:	1.75%

### Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VA200000
Ticker	VALMX20 B1

### Operación del fondo:

Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 08:30 a 14:30

\* 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		Retorno total		Retorno relativo	
Oct-2008	-24.8%	Feb-2022	-0.7%	Nov-2020	+13.3%	Mar-2020	+1.7%
Mar-2020	-19.3%	Dic-2020	-0.6%	May-2009	+12.7%	Feb-2020	+0.7%
Oct-2018	-11.6%	Nov-2020	-0.6%	Mar-2009	+11.6%	Ene-2021	+0.7%
Ene-2009	-10.0%	May-2009	-0.6%	Dic-2008	+11.5%	Ago-2011	+0.6%
Feb-2009	-9.5%	Oct-2020	-0.5%	Oct-2011	+9.7%	May-2020	+0.5%

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



## Portafolio

Información al 29 abril 2022

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales México	100.0%	96.4%
Efectivo / Fondo	-	3.6%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Consumo frecuente	28.4%
Materiales	18.7%
Comunicaciones	18.3%
Financieros	13.1%
Industrial	10.6%
Salud	4.1%
Efectivo / Fondo	3.6%
Consumo no básico	3.2%

Principales 10 tenencias	
América Móvil (AMX)	15.3%
Wal-Mart de México (WALMEX)	11.2%
Grupo Financiero Banorte (GFNORTE)	10.3%
Grupo México (GMEXICO)	9.4%
Fomento Económico Mexicano (FEMSA)	8.8%
Cementos Mexicanos (CEMEX)	5.0%
Genoma Lab International (LAB)	4.1%
Saldo Efectivo Pesos	3.6%
Grupo Aeroportuario del Pacífico (GAP)	3.4%
Grupo Televisa (TLEVISA)	3.0%
<b>Total</b>	<b>74.1%</b>

## Datos del portafolio

Emisoras y deversificación	
Número de emisoras	31
Diversificación (1/Herfindahl)	13

Portafolio por monedas	
Pesos	100.0%
UDIs	-
Dólares (EUA)	-
Euros	-

## Información adicional

Posibles adquirientes (sub series):	
Personas Físicas, Personas morales, Personas no sujetas a retención nacionales y/o extranjeras.	

Clasificación y Autorización CNBV:	
Fondo de inversión especializado en Mercados accionarios en México. Oficio No. 157/13036/2021 con fecha 26 de febrero del 2021	

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	
Legaría 549 Torre 2 Piso 7	
Colonia 10 de abril	
Alcaldía Miguel Hidalgo	
11250 Ciudad de México	
Teléfono (55) 5279-1200	
<a href="http://www.valmex.com.mx">www.valmex.com.mx</a>	

**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 con 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