



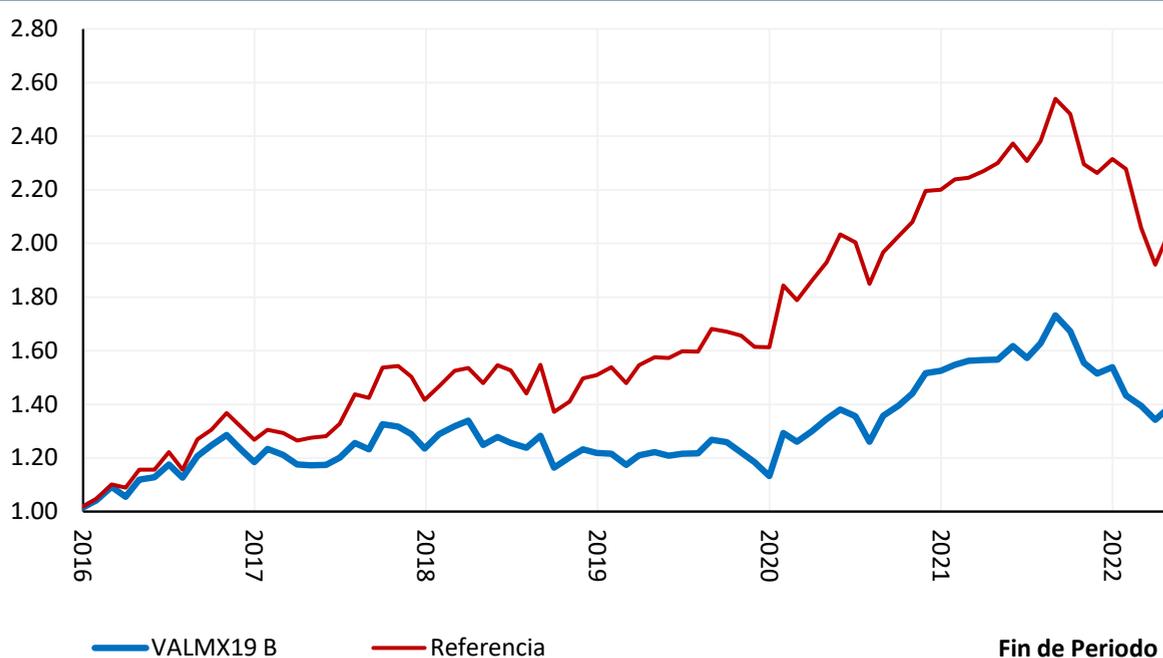
## Descripción del Fondo

El objetivo del fondo es invertir los recursos en activos de renta variable, de deuda. Lo anterior de manera directa o a través de vehículos de inversión colectiva tales como fondos de Inversión, títulos referenciados a acciones (Trackers) y/o Exchange Traded Funds (ETFs).

Información al 29 julio 2022

## Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Julio	Junio	Mayo	YTD	3 meses	6 meses
VALMX19 B	3.29	-3.69	-2.74	-17.14	-3.24	-10.88
Referencia	6.29	-6.63	-9.70	-17.78	-10.39	-11.05
Diferencia	-3.00	+2.94	+6.97	+0.65	+7.14	+0.18

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX19 B	-11.50	4.32	3.41			5.22
Referencia	-11.24	9.00	9.86			11.76
Diferencia	-0.26	-4.68	-6.45			-6.54

\* Datos de feb-16 a jul-22 de ser necesario se reconstruye la serie B a partir de la serie del capital fijo "A".

Caídas mensuales más importantes

Retorno total		Retorno relativo		Alzas mensuales más importantes		Retorno total		Retorno relativo	
Dic-2018	-9.3%	Abr-2022	-5.3%	Abr-2020	+14.2%	May-2022	+7.0%		
Oct-2020	-7.0%	Mar-2020	-4.4%	Nov-2020	+7.7%	Oct-2018	+4.2%		
Ene-2022	-7.0%	Oct-2017	-3.9%	Dic-2017	+7.6%	Jun-2022	+2.9%		
Abr-2022	-6.9%	Nov-2018	-3.8%	Nov-2016	+7.2%	Dic-2018	+2.0%		
Jul-2018	-6.8%	Feb-2019	-3.6%	Nov-2021	+6.3%	Mar-2018	+1.6%		

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

## 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

\$8,507 millones de Pesos

### Resumen Rendimientos:

Julio	3.29	6.29	-3.00
YTD	-17.14	-17.78	+0.65
12 meses	-11.50	-11.24	-0.26
Histórico*	5.22	11.76	-6.54

\* Datos de febrero 2016 a julio 2022.

### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	4.37%
Error de rastreo:	1.96%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	0.9720 / 0.0039

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.84%	5.75%
Consumo de VaR		32%

## Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B): 0.56%

Administración: 0.10%

Distribución: 0.46%

### Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VA2T0047
Ticker	VALMX19 B

### Operación del fondo:

Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 08:30 a 14:00

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



## Portafolio

Información al 29 julio 2022

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	100.0%	98.7%
Efectivo / Fondo	-	1.3%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Multi-Sectorial	98.7%
Efectivo / Fondo	1.3%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Multi-región	93.9%
Euro Zona	4.8%
Norte-América	1.0%
América Latina	0.3%

Principales 10 tenencias	
Valmex - Capitales Globales (VALMX28)	84.0%
Valmex - Brandes: Value Equities (VALMXVL)	9.8%
Valmex - EDM: Capitales España (VALMXES)	4.8%
Saldo Efectivo Dólares	1.0%
Saldo Efectivo Pesos	0.3%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	5
Diversificación (1/Herfindahl)	1

## Portafolio por monedas

Pesos	99.0%
UDIs	-
Dólares (EUA)	1.0%
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 Mercados accionarios globales. Oficio No. . 157/9791/2020 con fecha 30 de abril 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