

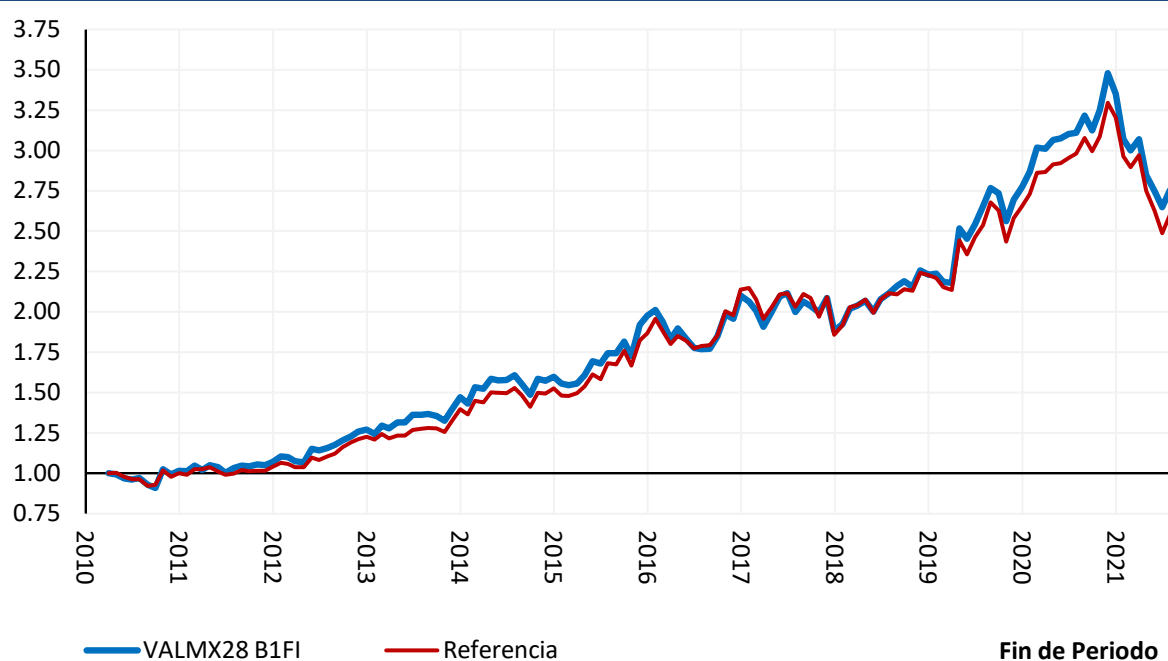


## Descripción del Fondo

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.

## Rendimientos (1)

### Valor teórico de \$1 Peso



### Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Julio	Junio	Mayo	YTD	3 meses	6 meses
VALMX28 B1FI	3.97	-3.60	-3.54	-17.81	-3.32	-10.30
Referencia	4.45	-5.27	-4.48	-18.91	-5.49	-12.33
Diferencia	-0.47	+1.68	+0.93	+1.10	+2.17	+2.03

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX28 B1FI	-11.49	9.19	9.26	7.99	10.31	9.35
Referencia	-12.79	7.11	7.75	7.87	10.04	8.79
Diferencia	+1.30	+2.08	+1.51	+0.12	+0.27	+0.56

\* Datos de mar-11 a jul-22 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%
Ene-2022	-8.4%	Sep-2011	-2.9%
Abr-2022	-7.2%	Mar-2012	-2.6%
Oct-2020	-6.3%	Jul-2016	-2.5%
Mar-2017	-5.6%	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.

Información al 29 julio 2022

### Portafolio de referencia

100.0% MSCI ACWI Index (net)

### Principales riesgos

Cambios: Exposición a varias monedas

Capitales: Exposición a mercados globales

### El fondo en números

#### Activos netos

\$22,139 millones de Pesos

#### Resumen Rendimientos:

Julio	3.97	4.45	-0.47
YTD	-17.81	-18.91	+1.10
12 meses	-11.49	-12.79	+1.30
Histórico*	9.35	8.79	+0.56

\* Datos de marzo 2011 a julio 2022.

#### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	4.48%
Error de rastreo:	0.85%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	0.9864 -0.0015

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.50%	4.50%
Consumo de VaR		33%

### Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1FI): 0.53%

Administración: 0.10%

Distribución: 0.43%

#### Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VA130016
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 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%	86.2%
Deuda Moneda Extranjera	-	10.0%
Fondo Mixto	-	2.4%
Efectivo / Fondeo	-	1.4%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Multi-Sectorial	53.3%
Gobierno Federal	10.0%
Salud	7.5%
Financieros	6.1%
Servicios públicos	4.2%
Consumo no básico	1.7%
Efectivo / Fondeo	1.4%
Industrial	1.4%
Energía	1.1%
Materiales	0.5%
Consumo frecuente	0.5%
Tecnología	0.3%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	62.7%
Multi-región	28.2%
Asia-Pacífico	3.7%
Euro Zona	2.9%
Asia Emergente	1.5%
Europa	1.0%
América Latina	0.0%

Distribución por plazo (solo deuda)	
Fondo / Tracker	10.0%
0-3 meses	1.4%
<b>Total deuda (duración bonos en directo 1.4% = 0.0 años)</b>	<b>11.4%</b>

Distribución por calificación (solo deuda)	
Fondeo diario	1.4%
Gobierno Federal	10.0%
<b>Total deuda</b>	<b>11.4%</b>

Principales 10 tenencias	
Valmex - JP Morgan: US Technology (VLMXTEC)	12.0%
iShares Barclays Short Treasury Bond (SHV)	10.0%
Vanguard Dividend Appreciation (VIG)	6.2%
Valmex - Brandes: Value Equities (VALMXVL)	6.0%
iShares Edge MSCI USA Quality Factor ETF (QUAL)	4.7%
Vanguard Value (VTV)	4.6%
Valmex - Alliance Bernstein LP (VALMXHC)	4.3%
Utilities Sector SPDR (XLU)	4.2%
iShares Edge MSCI Intl Quality Factor ETF (IQLT)	4.1%
Valmex - Brandes: Global Growth (VALMXGL)	3.8%

**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

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	46
Diversificación (1/Herfindahl)	20

## Portafolio por monedas

Pesos	24.7%
UDIs	-
Dólares (EUA)	74.8%
Euros	0.5%

## Información adicional

## Posibles adquirientes (sub series):

Personas físicas, Personas morales, Cajas y fondos de ahorro.

## Clasificación y Autorización CNBV:

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