



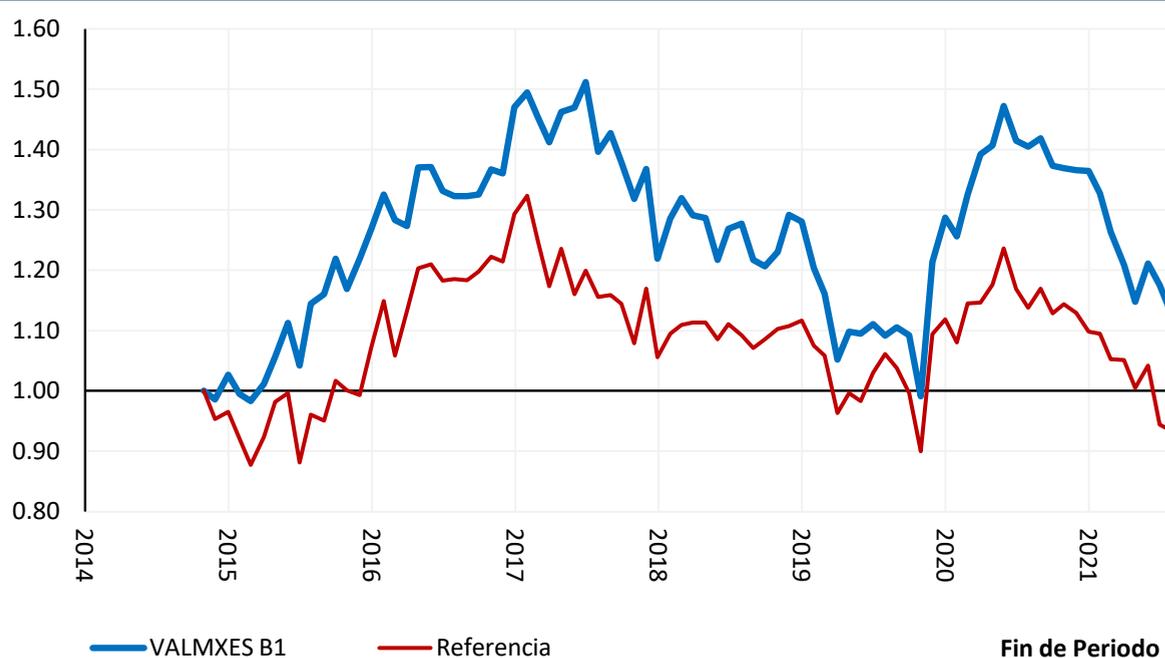
## Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es invertir los recursos captados del público inversionista en acciones de empresas españolas o cuya actividad preponderante sea en España, y que se encuentren listadas en el SIC (Sistema Internacional de Cotizaciones). El fondo es asesorado por EDM, en Barcelona España, y basado en su fondo EDM Spanish Equities". EDM es un destacado gestor independiente.

Información al 29 julio 2022

## Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



### Portafolio de referencia

100.0% iShares MSCI Spain

### Principales riesgos

Cambios: Exposición al Euro  
 Capitales: Exposición a mercados globales

### El fondo en números

#### Activos netos

\$462.7 millones de Pesos

#### Resumen Rendimientos:

Julio	-3.91	-1.07	-2.84
YTD	-17.21	-14.98	-2.23
12 meses	-19.58	-17.91	-1.67
Histórico*	1.82	-1.01	+2.83

\* Datos de octubre 2015 a julio 2022.

#### Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	5.57%
Error de rastreo:	2.63%
Beta ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ )	0.8586 -0.0013

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

VaR (4) y límite de VaR:	2.44%	3.07%
Consumo de VaR	79%	

#### Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Julio	Junio	Mayo	YTD	3 meses	6 meses
VALMXES B1	-3.91	-2.91	5.50	-17.21	-1.57	-14.91
Referencia	-1.07	-9.38	3.66	-14.98	-7.07	-14.68
Diferencia	-2.84	+6.47	+1.85	-2.23	+5.50	-0.24

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

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMXES B1	-19.58	-4.00	-3.11			1.82
Referencia	-17.91	-5.09	-4.65			-1.01
Diferencia	-1.67	+1.09	+1.54			+2.83

\* Datos de oct-15 a jul-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):	2.03%
Administración:	1.18%
Distribución:	0.85%

#### Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VA190028
Ticker	VALMXES B1

#### Operación del fondo:

Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 08:30 a 09:30

\* 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
Dic-2018 -10.8%	Mar-2017 -7.8%
Mar-2020 -9.4%	Jul-2020 -4.7%
Oct-2020 -9.3%	Nov-2018 -4.7%
Jul-2018 -7.7%	Mar-2022 -4.1%
Jun-2016 -6.3%	Jul-2018 -4.0%

#### Alzas mensuales más importantes

Retorno total	Retorno relativo
Nov-2020 +22.5%	May-2018 +6.6%
Jul-2016 +9.8%	Jun-2022 +6.5%
Dic-2017 +8.1%	Jun-2016 +5.2%
Abr-2017 +7.6%	Nov-2016 +5.1%
Dic-2020 +6.0%	Mar-2021 +4.9%

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



## Portafolio

Información al 29 julio 2022

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	100.0%	99.7%
Efectivo / Fondo	-	0.3%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Industrial	28.9%
Consumo no básico	17.1%
Materiales	16.7%
Financieros	9.7%
Salud	9.1%
Energía	6.2%
Tecnología	4.5%
Consumo frecuente	4.1%
Comunicaciones	3.4%
Efectivo / Fondo	0.3%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Euro Zona	95.6%
Multi-región	4.1%
América Latina	0.3%

Principales 10 tenencias	
Grupo Catalana Occidente (GCO)	6.6%
Contrucciones y Auxiliar de Ferrocarriles (CAFE)	6.4%
Gestamp Automoción (GEST)	6.3%
Repsol (REPS)	6.2%
Industria de Diseño Textil (ITX)	6.1%
Grifols (GRFP)	5.1%
CIE Automotive (CIEA)	4.7%
Global Dominion (DOM)	4.5%
Fluidra (FDR)	4.4%
CocaCola European Partners PLC (CCEP)	4.1%
<b>Total</b>	<b>54.5%</b>

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

Número de emisoras	24
Diversificación (1/Herfindahl)	21

## Portafolio por monedas

Pesos	0.3%
UDIs	-
Dólares (EUA)	-
Euros	99.7%

## Información adicional

## Posibles adquirientes (sub series):

Personas físicas, Personas morales y personas no sujetas a retención nacionales y/o extranjeras.

## Clasificación y Autorización CNBV:

Fondo de inversión especializado en Mercados accionarios globales. Oficio No. 157/9790/2020 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