VALMX28

Fondo de renta variable diversificado en las regiones y sectores que ofrezcan un valor agregado al mercado global

Descripción del Fondo

Información al 29 septiembre 2023

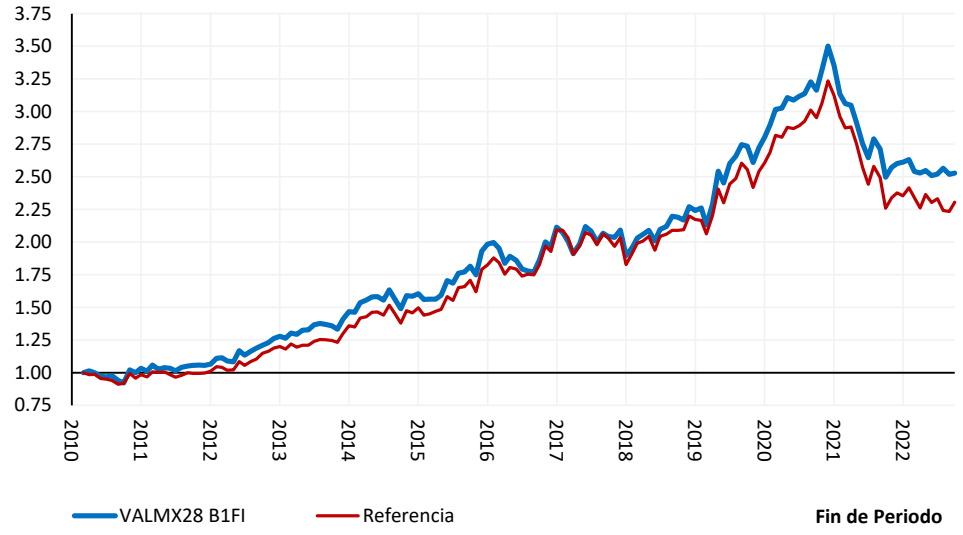
Es un fondo cuyo objetivo es invertir los recursos captados del público inversionista en Acciones y otros vehículos de inversión colectiva como ETF´s (Exchange Traded Funds) y Fondos de Inversión, de los mercados de capitales y de deuda nacionales e internacionales, desarrollados y emergentes, listados en el SIC (Sistema Internacional de Cotizaciones). El fondo busca preservar el capital en el largo plazo a través de la diversifiación a lom largo de sectores y regiones, buscando aquellos que ofrecen mayor potencial de crecimiento, pero con menor riesgo.

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

$12,692 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

Septiembre	**0.38**	3.17	-2.79
YTD	**-3.24**	-2.06	-1.18
12 meses	**1.26**	2.08	-0.82
Histórico*	**7.65**	6.87	+0.78

* Datos de febrero 2011 a septiembre 2023.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:		3.44%
Error de rastreo:		1.55%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0309	-0.0005

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.40%	4.50%
Consumo de VaR		31%

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Septiembre	Agosto	Julio	YTD	3 meses	6 meses
VALMX28 B1FI	**0.38**	**-1.85**	**1.74**	**-3.24**	**0.24**	**-0.02**
Referencia	3.17	-0.32	-3.91	-2.06	-1.18	2.00
Diferencia	-2.79	-1.53	+5.65	-1.18	+1.42	-2.01

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX28 B1FI	**1.26**	**-2.57**	**4.36**	**4.84**	**7.65**	**7.65**
Referencia	2.08	-3.36	2.56	4.38	7.23	6.87
Diferencia	-0.82	+0.79	+1.80	+0.45	+0.43	+0.78

* Datos de feb-11 a sep-23 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	-9.4%	Abr-2023	-3.7%
Sep-2022	-8.0%	Sep-2023	-2.8%
Ene-2022	-6.5%	Sep-2011	-2.7%
Mar-2017	-5.9%	Mar-2012	-2.5%
Feb-2020	-5.7%	Ene-2017	-2.3%

Alzas mensuales más importantes

Retorno total		Retorno relativo	
Abr-2020	+11.1%	Jul-2023	+5.7%
Oct-2011	+10.8%	Mar-2023	+2.9%
Nov-2016	+10.3%	Oct-2018	+2.8%
May-2013	+8.0%	Mar-2011	+2.8%
Dic-2017	+7.6%	Oct-2011	+2.6%

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

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.

VALORES MEXICANOS

VALMX28

Fondo de renta variable diversificado en las regiones y sectores que ofrezcan un valor agregado al mercado global

Portafolio

Información al 29 septiembre 2023

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	100.0%	86.5%
Deuda Moneda Extranjera	-	9.2%
Fondo Mixto	-	2.5%
Efectivo / Fondeo	-	1.8%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Multi-Sectorial	65.4%
Salud	8.6%
Gobierno Federal	3.0%
Industrial	1.8%
Efectivo / Fondeo	1.8%
Energía	1.5%

Distribución por región (inlcuye deuda y capitales)	
Norte-América	61.0%
Multi-región	29.0%
Euro Zona	5.5%
Asia-Pacífico	3.9%
América Latina	0.7%

Distribución por plazo (solo deuda)		
Fondo / Tracker	-	9.2%
0-3 meses	-	1.8%
Total deuda (duración bonos en directo 1.8% = 0.0 años)	-	11.0%

Distribución por calificación (solo deuda)	
Tracker / Fondo	6.1%
Fondeo diario	1.8%
Gobierno Federal	3.0%
Total deuda	**11.0%**

Principales 10 tenencias	
Valmex - JP Morgan: US Technology (VLMXTEC)	17.9%
Valmex - Brandes: Value Equities (VALMXVL)	10.7%
iShares Edge MSCI USA Quality Factor ETF (QUAL)	8.8%
Vanguard Dividend Appreciation (VIG)	7.5%
iShares Floating Rate Bond UCITS (FLOA)	6.1%
iShares Edge MSCI Intl Quality Factor ETF (IQLT)	5.3%
Valmex - Alliance Bernstein LP (VALMXHC)	5.2%
Vanguard Value (VTV)	5.0%
iShares MSCI EMU (EZU)	3.9%
iShares Short Treasury Bond UCITS (IB01)	3.0%
Total	**73.3%**

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación	
Número de emisoras	27
Diversificación (1/Herfindahl)	13

Portafolio por monedas	
Pesos	38.0%
UDIs	-
Dólares (EUA)	62.0%
Euros	-

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

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 (ß) mide la relación y sensibilidad de los retornos con respecto a la referencia; finalmente, el alfa (α) 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. Es importante consultar con su asesor cual es su perfil de inversión. Este documento no pude ser reproducido total o parcialmente sin la autorización de Valores Mexicanos Casa de Bolsa, SA de CV