



## Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es ofrecer una alternativa de cobertura cambiaria respecto al Dólar americano. La inversión principal será en depósitos en chequera denominados en Dólares y en papeles gubernamentales de deuda denominados en Dólares americanos (Bonos UMS).

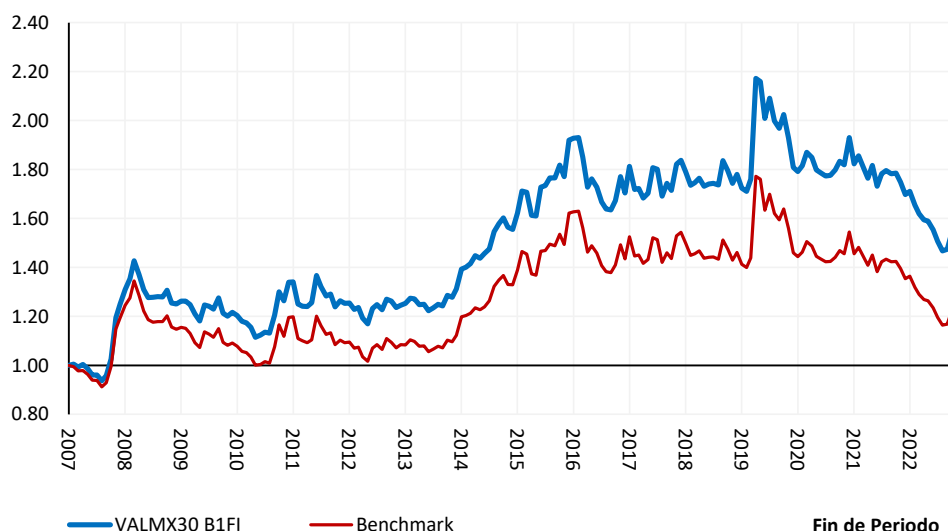
Información al 29 septiembre 2023

### Portafolio Benchmark

100.0% Dólar Spot

## Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



### Principales riesgos

Tasas: Bajo (bonos corto plazo)  
Crédito: Bajo (guber y chequeras)  
Cambios: Exposición al Dólar

### El fondo en números

#### Activos netos

\$347.3 millones de Pesos

#### Resumen Rendimientos:

|            |        |        |       |
|------------|--------|--------|-------|
| Septiembre | 4.52   | 4.63   | -0.11 |
| YTD        | -9.92  | -10.39 | +0.47 |
| 12 meses   | -13.67 | -14.18 | +0.51 |
| Histórico* | 2.78   | 1.29   | +1.50 |

\* Datos de diciembre 2007 a septiembre 2023.

#### Datos estadísticos (2):

|                     |                |
|---------------------|----------------|
| Volatilidad:        | 2.76%          |
| Error de rastreo:   | 0.05%          |
| Beta (β) / Alfa (α) | 1.0097 -0.0005 |

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

|                          |       |       |
|--------------------------|-------|-------|
| VaR (4) y límite de VaR: | 1.19% | 2.06% |
| Consumo de VaR           |       | 57%   |

#### Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

|              | Septiembre | Agosto | Julio | YTD    | 3 meses | 6 meses |
|--------------|------------|--------|-------|--------|---------|---------|
| VALMX30 B1FI | 4.52       | 0.45   | -2.59 | -9.92  | 2.26    | -3.32   |
| Benchmark    | 4.63       | 0.41   | -2.69 | -10.39 | 2.23    | -3.60   |
| Diferencia   | -0.11      | +0.04  | +0.10 | +0.47  | +0.04   | +0.28   |

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

|              | 12 meses | 3 años | 5 años | 7 años | 10 años | Histórico* |
|--------------|----------|--------|--------|--------|---------|------------|
| VALMX30 B1FI | -13.67   | -8.70  | -2.11  | -2.33  | 2.02    | 2.78       |
| Benchmark    | -14.18   | -9.30  | -3.16  | -3.20  | 1.12    | 1.29       |
| Diferencia   | +0.51    | +0.60  | +1.05  | +0.86  | +0.89   | +1.50      |

\* Datos de dic-07 a sep-23 de ser necesario se reconstruye la serie B1FI a partir de la serie del capital fijo "A".

#### Algunos datos prácticos

|                                  |       |
|----------------------------------|-------|
| Comisiones anuales (serie B1FI): | 0.92% |
| Administración:                  | 0.27% |
| Distribución:                    | 0.65% |

#### Como encontrar el fondo:

|        |              |
|--------|--------------|
| ISIN   | MX51VA2N0060 |
| Ticker | VALMX30 B1FI |

#### Operación del fondo:

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| Liquidez (compra)   | Diaria           |
| Liquidez (venta)    | Diaria           |
| Plazo liquidación   | 48 Horas         |
| Horario operación * | De 08:00 a 13:00 |

\* 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 |
|---------------|------------------|
| May-2020      | -7.0%            |
| Ene-2012      | -6.8%            |
| Mar-2017      | -6.6%            |
| Nov-2020      | -6.2%            |
| Jul-2018      | -6.1%            |
| Nov-2011      | -1.0%            |
| Dic-2014      | -0.7%            |
| Jun-2015      | -0.6%            |
| Ago-2013      | -0.6%            |
| Nov-2013      | -0.6%            |

#### Alzas mensuales más importantes

| Retorno total | Retorno relativo |
|---------------|------------------|
| Mar-2020      | +23.4%           |
| Oct-2008      | +16.4%           |
| May-2012      | +8.9%            |
| Nov-2016      | +8.5%            |
| Sep-2011      | +7.9%            |
| Oct-2011      | +1.2%            |
| Mar-2008      | +1.1%            |
| Oct-2008      | +1.0%            |
| Ene-2008      | +1.0%            |
| Ene-2009      | +1.0%            |

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



## Portafolio

| Distribución por mercado                            | Benchmark | Portafolio    |
|-----------------------------------------------------|-----------|---------------|
| Efectivo / Fondeo                                   | -         | 100.0%        |
| Distribución por sector (deuda y capitales)         |           |               |
| Efectivo / Fondeo                                   |           | 100.0%        |
| Distribución por región (incluye deuda y capitales) |           |               |
| Norte-América                                       |           | 97.0%         |
| América Latina                                      |           | 3.0%          |
| Principales 10 tenencias                            |           |               |
| Saldo Efectivo Dólares                              |           | 97.0%         |
| Saldo Efectivo Pesos                                |           | 3.0%          |
| <b>Total</b>                                        |           | <b>100.0%</b> |

Información al 29 septiembre 2023

## Datos del portafolio

## Emisoras y deversificación

|                                |   |
|--------------------------------|---|
| Número de emisoras             | 2 |
| Diversificación (1/Herfindahl) | 1 |

## Portafolio por monedas

|               |       |
|---------------|-------|
| Pesos         | 3.0%  |
| UDIs          | -     |
| Dólares (EUA) | 97.0% |
| 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 Deuda denominada en Dólares. Oficio No. 157/90511/2019 con fecha 26 de julio del 2019.

## 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. / Calificadora: HR Ratings

## Contactos

Legaría 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 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