

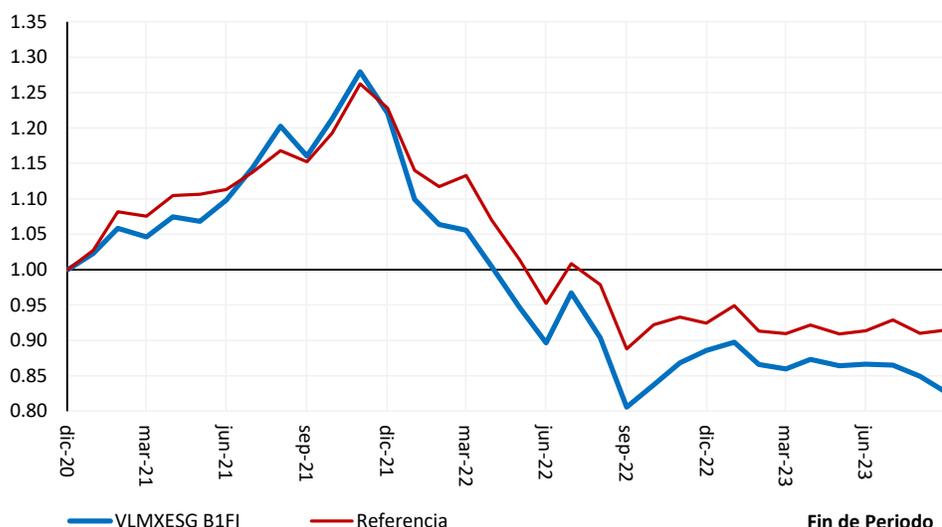


Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es invertir los recursos captados del público inversionista en acciones de los mercados de capitales internacionales, listadas en el SIC (sistema Internacional de Cotizaciones). Este fondo busca ofrecer crecimiento de capital a largo plazo invirtiendo principalmente en empresas globales que tienen una preocupación por temas ESG (Environment, Social and Governance por sus siglas en inglés). Este fondo está asesorado por Mirova y está basado un su fondo "Mirova Global Sustainable Equity Fund".

Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Septiembre	Agosto	Julio	YTD	3 meses	6 meses
VLMXESG B1FI	-2.62	-1.83	-0.13	-6.60	-4.52	-3.80
Referencia	0.51	-2.03	1.67	-1.07	0.12	0.55
Diferencia	-3.13	+0.19	-1.79	-5.53	-4.64	-4.35

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VLMXESG B1FI	2.67					-6.67
Referencia	3.00					-3.20
Diferencia	-0.33					-3.47

* Datos de dic-20 a sep-23 de ser necesario se reconstruye la serie B1FI a partir de la serie del capital fijo "A".

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

Información al 29 septiembre 2023

Portafolio de referencia

100.0% iShares Core MSCI World UCITS

Principales riesgos

Crédito: Medio (a través de ETFs de deuda)

Cambios: Exposición a monedas

Capitales: Exposición a mercados globales y locales

El fondo en números

Activos netos

\$647.7 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

Septiembre	-2.62	0.51	-3.13
YTD	-6.60	-1.07	-5.53
12 meses	2.67	3.00	-0.33
Histórico*	-6.67	-3.20	-3.47

* Datos de diciembre 2020 a septiembre 2023.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	4.45%
Error de rastreo:	1.68%
Beta (β) / Alfa (α)	0.7775 0.0017

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.82%	5.00%
Consumo de VaR		36%

Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1FI):	2.24%
Administración:	1.18%
Distribución:	1.06%

Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VLOB0046
Ticker	VLMXESG B1FI

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 septiembre 2023

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Capitales Globales	-	97.4%
Efectivo / Fondo	-	2.6%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Tecnología	20.8%
Salud	20.6%
Industrial	16.2%
Financieros	10.7%
Servicios públicos	7.9%
Consumo no básico	5.6%
Materiales	5.3%
Energía	4.0%
Bonos (activos)	3.1%
Efectivo / Fondo	2.6%
Consumo frecuente	2.2%
Comunicaciones	1.0%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	65.1%
Euro Zona	20.1%
Asia-Pacífico	8.4%
Multi-región	5.2%
América Latina	1.3%

Principales 10 tenencias	
Mastercard (MA)	5.3%
Novo Nordisk (NVO)	5.3%
Microsoft (MSFT)	5.0%
Nvidia (NVDA)	4.4%
Adobe Systems (ADBE)	4.4%
Thermo Fisher Scientific (TMO)	4.4%
Ebay Inc (EBAY)	4.4%
Eli Lilly and Company (LLY)	3.9%
Roper Technologies (ROP)	3.7%
Ecolab Inc (ECL)	3.5%
Total	44.5%

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación	
Número de emisoras	44
Diversificación (1/Herfindahl)	32

Portafolio por monedas	
Pesos	1.3%
UDIs	-
Dólares (EUA)	74.8%
Euros	14.8%

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. 157/10021/2020 con fecha 18 de diciembre 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
 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

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 (β) 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 puede ser reproducido total o parcialmente sin la autorización de Valores Mexicanos Casa de Bolsa, SA de CV