



Descripción del Fondo

El objetivo del fondo es invertir los recursos en activos de renta variable, de deuda. Lo anterior de manera directa o a través de vehículos de inversión colectiva tales como fondos de Inversión, títulos referenciados a acciones (Trackers) y/o Exchange Traded Funds (ETFs).

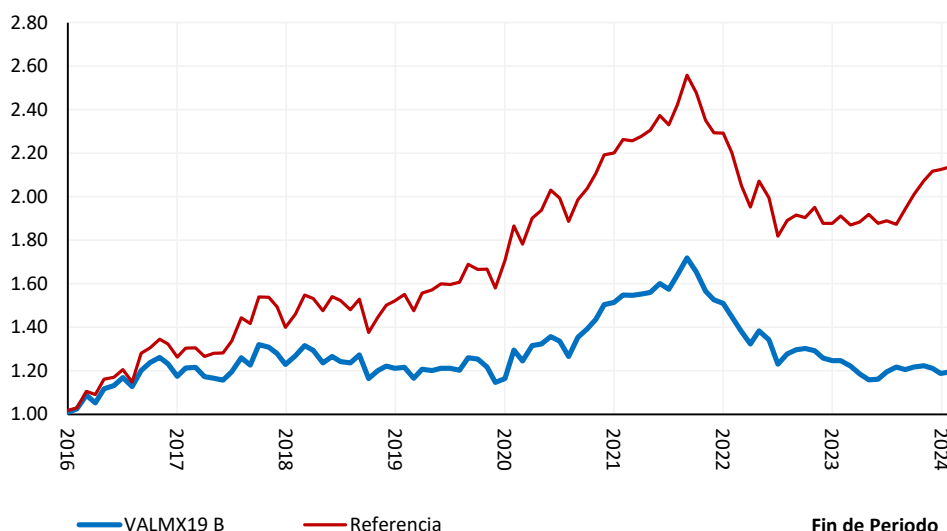
Información al 30 abril 2024

Portafolio de referencia

100.0% iShares MSCI All Country World

Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Principales riesgos

Cambios: Exposición a monedas

Capitales: Exposición a mercados globales

El fondo en números

Activos netos

\$6,835 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

	0.72	0.61	+0.10
Abril	0.72	0.61	+0.10
YTD	-1.83	6.36	-8.19
12 meses	-4.12	11.81	-15.93
Histórico*	2.21	9.75	-7.54

* Datos de febrero 2016 a abril 2024.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	2.94%
Error de rastreo:	1.83%
Beta (β) / Alfa (α)	0.9852 0.0056

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

VaR (4) y límite de VaR:	0.89%	5.75%
Consumo de VaR		15%

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Abril	Marzo	Febrero	YTD	3 meses	6 meses
VALMX19 B	0.72	-1.96	-1.04	-1.83	-2.29	-1.82
Referencia	0.61	0.36	2.12	6.36	3.12	14.12
Diferencia	+0.10	-2.33	-3.17	-8.19	-5.41	-15.94

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX19 B	-4.12	-8.26	-0.34	-0.20		2.21
Referencia	11.81	-1.89	6.62	7.31		9.75
Diferencia	-15.93	-6.37	-6.97	-7.51		-7.54

* Datos de feb-16 a abr-24 de ser necesario se reconstruye la serie B a partir de la serie del capital fijo "A".

Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B):	0.56%
Administración:	0.10%
Distribución:	0.46%

Como encontrar el fondo:

ISIN	MX52VA2T0047
Ticker	VALMX19 B

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.

Caídas mensuales más importantes

Retorno total		Retorno relativo		Retorno total		Retorno relativo	
Dic-2018	-8.5%	Mar-2020	-6.4%	Abr-2020	+11.2%	Oct-2023	+2.8%
Sep-2022	-8.3%	Nov-2016	-5.0%	Dic-2017	+7.7%	Oct-2018	+2.4%
Feb-2020	-5.8%	Nov-2023	-4.7%	Nov-2020	+7.0%	Ago-2023	+2.4%
Ene-2022	-5.3%	Jul-2023	-4.2%	Nov-2016	+6.5%	Mar-2018	+2.3%
Oct-2020	-5.3%	Jun-2023	-3.6%	Jul-2016	+6.2%	Sep-2023	+2.3%

Alzas mensuales más importantes

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



Portafolio

Información al 30 abril 2024

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Deuda Moneda Extranjera	-	78.0%
Capitales Globales	100.0%	19.9%
Efectivo / Fondo	-	2.1%

Distribución por sector (deuda y capitales)	
Gobierno Federal	24.9%
Financieros	18.9%
Multi-Sectorial	13.4%
Efectivo / Fondo	2.1%

Distribución por región (incluye deuda y capitales)	
Norte-América	40.2%
Euro Zona	18.9%
América Latina	0.3%

Distribución por plazo (solo deuda)	
Fondo / Tracker	78.0%
0-3 meses	2.1%
Total deuda (duración bonos en directo 2.1% = 0.0 años)	80.1%

Distribución por calificación (solo deuda)	
Tracker / Fondo	53.1%
Fondo diario	2.1%
Gobierno Federal	24.9%
Total deuda	80.1%

Principales 10 tenencias	
Valmex - Deuda Global (VLMXDME)	40.7%
iShares Treasury Bond 7-10 year UCITS (CBU0)	13.7%
Vanguard USD Corporate Bond UCITS ETF (VDPA)	12.8%
iShares Treasury Bond 3-7 year UCITS (CBU7)	9.8%
iShares \$ Short Duration Corp Bond UCITS (SDIA)	6.4%
iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF USD (IMBA)	6.1%
iShares \$ TIPS UCITS ETF USD (IDTP)	6.0%
Saldo Efectivo Dólares	1.9%
iShares Short Treasury Bond UCITS (IB01)	1.4%
Vangard US Treasury 0-1 Bond UCITS ETF (USD) Accumulating (VDS)	1.0%
Total	99.7%

Datos del portafolio

Emisoras y deversificación	
Número de emisoras	11
Diversificación (1/Herfindahl)	5

Portafolio por monedas	
Pesos	40.9%
UDIs	-
Dólares (EUA)	59.1%
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 Mercados accionarios globales. Oficio No. . 157/9791/2020 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	
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