



## 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).

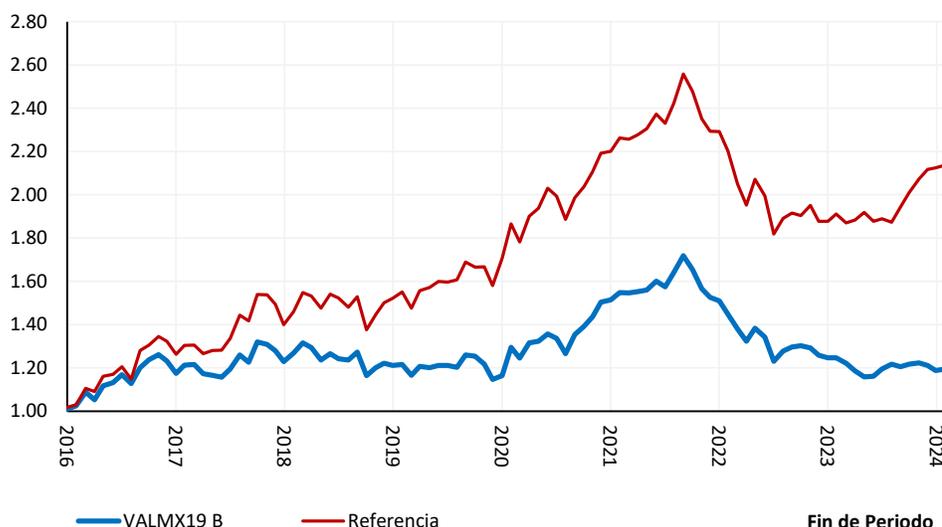
Información al 30 abril 2024

### 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 ( $\beta$ ) / Alfa ( $\alpha$ ) | 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%         |
| <b>Total deuda (duración bonos en directo 2.1% = 0.0 años)</b> | <b>80.1%</b> |

| Distribución por calificación (solo deuda) |              |
|--|--------------|
| Tracker / Fondo                            | 53.1%        |
| Fondeo diario                              | 2.1%         |
| Gobierno Federal                           | 24.9%        |
| <b>Total deuda</b>                         | <b>80.1%</b> |

| 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%         |
| <b>Total</b>  | <b>99.7%</b> |

## 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](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