

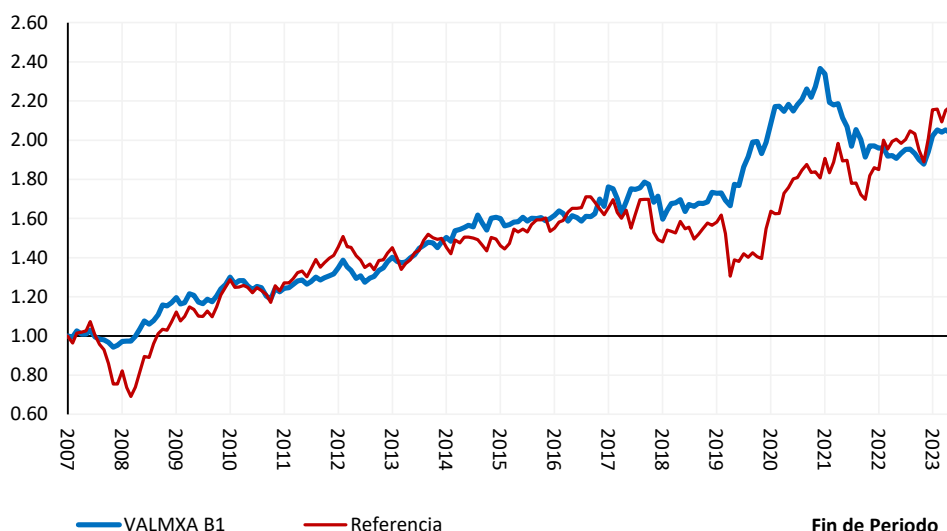


Descripción del Fondo

Es un fondo cuyo objetivo es ofrecer al público inversionista, rendimientos en el largo plazo, con base en un modelo de asignación óptima de activos, buscando las mejores oportunidades coyunturales a través de vehículos de inversión de capitales o de deuda, tanto nacionales como extranjeros. Corresponde a un nivel de inversionistas con un perfil de riesgo alto.

Rendimientos (1)

Valor teórico de \$1 Peso



Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

| | Abril | Marzo | Febrero | YTD | 3 meses | 6 meses |
|------------|-------|-------|---------|-------|---------|---------|
| VALMXA B1 | -0.73 | 0.55 | -0.56 | 0.75 | -0.74 | 8.49 |
| Referencia | 1.02 | 2.79 | -3.02 | 0.85 | 0.70 | 15.08 |
| Diferencia | -1.75 | -2.24 | +2.46 | -0.10 | -1.44 | -6.60 |

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

| | 12 meses | 3 años | 5 años | 7 años | 10 años | Histórico* |
|------------|----------|--------|--------|--------|---------|------------|
| VALMXA B1 | 6.84 | -2.29 | 3.73 | 3.38 | 3.83 | 4.45 |
| Referencia | 8.36 | 7.31 | 6.51 | 4.00 | 4.58 | 4.87 |
| Diferencia | -1.53 | -9.60 | -2.78 | -0.62 | -0.75 | -0.42 |

* Datos de dic-07 a abr-24 de ser necesario se reconstruye la serie B1 a partir de la serie del capital fijo "A".

| Caídas mensuales más importantes | | | | Alzas mensuales más importantes | | | |
|----------------------------------|-------|------------------|-------|---------------------------------|-------|------------------|--------|
| Retorno total | | Retorno relativo | | Retorno total | | Retorno relativo | |
| Dic-2018 | -6.9% | Nov-2020 | -8.0% | Abr-2020 | +6.5% | Mar-2020 | +12.7% |
| Ene-2022 | -6.2% | Ene-2023 | -8.0% | Dic-2017 | +5.9% | Ene-2009 | +10.6% |
| Oct-2018 | -5.1% | Mar-2021 | -7.6% | Jun-2020 | +5.3% | Oct-2008 | +9.9% |
| Jun-2022 | -4.8% | Abr-2009 | -6.9% | Dic-2020 | +5.0% | May-2018 | +9.4% |
| Sep-2022 | -4.5% | Dic-2008 | -6.8% | Oct-2011 | +4.6% | Oct-2017 | +6.6% |

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

Información al 30 abril 2024

Portafolio de referencia

20.0% FTSE-PiPG-Cetes
80.0% S&P/BMV IRT

Principales riesgos

Tasas: Bajo a moderado
Inflación: Bajo
Crédito: Bajo (a través de fondos)
Cambios: Exposición a varias monedas
Capitales: Exposición a mercados globales

El fondo en números

Activos netos

\$203.2 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

| | | | |
|------------|-------|------|-------|
| Abril | -0.73 | 1.02 | -1.75 |
| YTD | 0.75 | 0.85 | -0.10 |
| 12 meses | 6.84 | 8.36 | -1.53 |
| Histórico* | 4.45 | 4.87 | -0.42 |

* Datos de diciembre 2007 a abril 2024.

Datos estadísticos (2):

| | |
|--------------------------------------|---------------|
| Volatilidad: | 2.48% |
| Error de rastreo: | 2.94% |
| Beta (β) / Alfa (α) | 0.8029 0.0078 |

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

| | | |
|--------------------------|-------|-------|
| VaR (4) y límite de VaR: | 0.46% | 3.35% |
| Consumo de VaR | | 14% |

Algunos datos prácticos

| | |
|--------------------------------|-------|
| Comisiones anuales (serie B1): | 1.51% |
| Administración: | 0.36% |
| Distribución: | 1.15% |

Como encontrar el fondo:

| | |
|--------|--------------|
| ISIN | MX52VA2W0026 |
| Ticker | VALMXA B1 |

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.



Portafolio

Información al 30 abril 2024

| Distribución por mercado | Referencia | Portafolio |
|--------------------------|------------|------------|
| Capitales Globales | - | 38.7% |
| Deuda Pesos | 20.0% | 34.0% |
| Efectivo / Fondeo | - | 18.7% |
| Capitales México | 80.0% | 5.4% |
| Deuda UDIs | - | 3.2% |

| Distribución por sector (deuda y capitales) | |
|---|-------|
| Efectivo / Fondeo | 18.7% |
| Multi-Sectorial | 17.6% |
| Financieros | 13.0% |
| Gobierno Federal | 9.8% |
| Comunicaciones | 3.9% |
| Salud | 2.9% |
| Energía | 2.8% |
| Industrial | 2.1% |
| Tecnología | 1.7% |

| Distribución por región (incluye deuda y capitales) | |
|---|-------|
| México | 32.8% |
| América Latina | 28.4% |
| Norte-América | 27.2% |
| Multi-región | 9.3% |
| Asia Emergente | 2.3% |

| Distribución por plazo (solo deuda) | |
|---|--------------|
| Fondo / Tracker | - |
| 0-3 meses | - |
| 6-12 meses | 20.0% |
| 1-3 años | - |
| 20-30 años | - |
| Total deuda (duración bonos en directo 28.5% = 1.0 años) | 20.0% |

| Distribución por calificación (solo deuda) | |
|--|--------------|
| Fondeo diario | 18.7% |
| Gobierno Federal | 37.2% |
| Total deuda | 55.9% |

| Principales 10 tenencias | |
|---|-------|
| Valmex - Deuda Nominal 3-5 años (VALMX15) | 24.9% |
| Saldo Efectivo Pesos | 18.6% |
| Certificados de la Tesorería (Abr-26) | 9.1% |
| Valmex - Capitales México Dinamico (VALMX20) | 5.4% |
| First Trust Smid Cap Rising Dividend Achievers Etf (SDVY) | 4.7% |
| iShares MSCI Emerging Markets (EEM) | 4.6% |
| Valmex - Brandes: Value Equities (VALMXVL) | 4.6% |
| Communication Services Select Sector SPDR Fund (XLC) | 3.9% |
| Invesco S&P500 EQUAL WEIGHT (RSP) | 3.2% |
| iShares S&P 500 (IVV) | 3.0% |

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

Datos del portafolio

| Emisoras y deversificación | |
|--------------------------------|----|
| Número de emisoras | 19 |
| Diversificación (1/Herfindahl) | 8 |

| Portafolio por monedas | |
|------------------------|-------|
| Pesos | 65.2% |
| UDIs | 0.6% |
| Dólares (EUA) | 34.2% |
| Euros | - |

Información adicional

| Posibles adquirientes (sub series): | |
|---|--|
| Personas físicas, Personas morales, Personas no sujetas a retención nacionales y/o extranjeras. | |

| Clasificación y Autorización CNBV: | |
|---|--|
| Fondo de inversión especializado en Activos con asignación discrecional. Oficio No. 157/90496/2019 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. | |

| 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