



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).

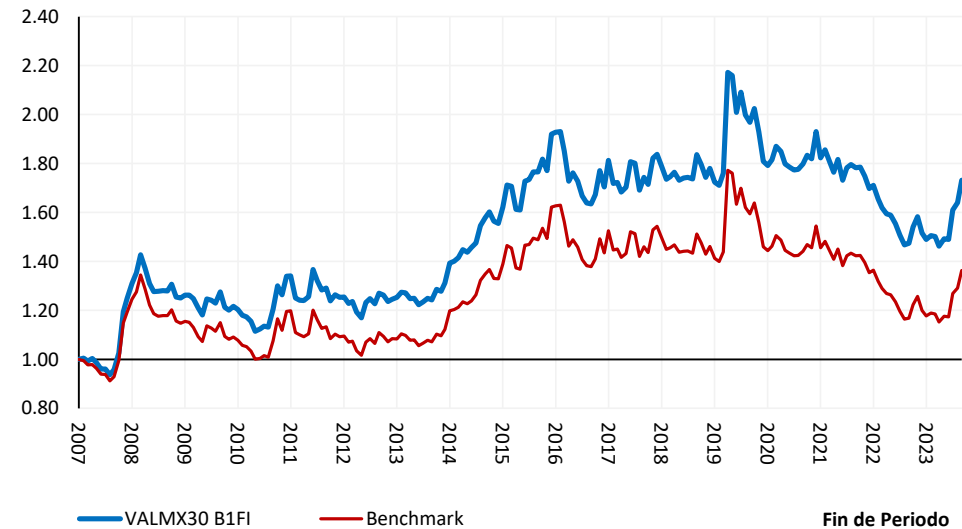
Información al 30 agosto 2024

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

\$363.9 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:

Agosto	5.57	5.61	-0.04
YTD	16.23	15.78	+0.45
12 meses	17.45	16.62	+0.82
Histórico*	3.35	1.88	+1.47

* Datos de diciembre 2007 a agosto 2024.

Datos estadísticos (2):

Volatilidad:	3.12%
Error de rastreo:	0.08%
Beta (β) / Alfa (α)	1.0138 -0.0005

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

VaR (4) y límite de VaR:	1.35%	2.19%
Consumo de VaR		62%

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Agosto	Julio	Junio	YTD	3 meses	6 meses
VALMX30 B1FI	5.57	1.87	8.11	16.23	16.27	15.29
Benchmark	5.61	1.74	8.15	15.78	16.20	14.99
Diferencia	-0.04	+0.13	-0.03	+0.45	+0.07	+0.30

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX30 B1FI	17.45	-1.26	-1.17	0.82	3.37	3.35
Benchmark	16.62	-1.86	-2.06	-0.16	2.44	1.88
Diferencia	+0.82	+0.60	+0.89	+0.99	+0.94	+1.47

* Datos de dic-07 a ago-24 de ser necesario se reconstruye la serie B1FI a partir de la serie del capital fijo "A".

Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1FI):

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%
Jun-2024	+8.1%
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

Información al 30 agosto 2024

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		97.9%
América Latina		2.1%
Principales 10 tenencias		
Saldo Efectivo Dólares		97.9%
Saldo Efectivo Pesos		2.1%
Total		100.0%

Datos del portafolio	
Emisoras y deversificación	
Número de emisoras	2
Diversificación (1/Herfindahl)	1
Portafolio por monedas	
Pesos	2.1%
UDIs	-
Dólares (EUA)	97.9%
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

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 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. 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