



Descripción del Fondo

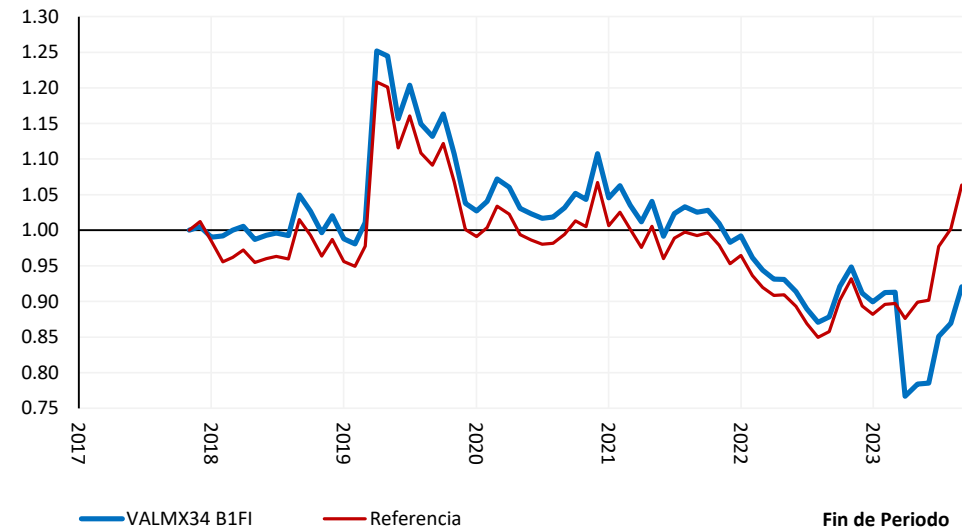
El objetivo del fondo es invertir los recursos captados del público inversionista en valores de deuda denominados en Dólares americanos y emitidos por el gobierno Federal de los Estados Unidos.

Información al 30 agosto 2024

Portafolio de referencia
100.0% FTSE-PiP-TB3M -SP

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
\$565.5 millones de Pesos

Resumen Rendimientos:			
Agosto	5.89	6.14	-0.25
YTD	2.33	20.64	-18.31
12 meses	4.82	24.01	-19.19
Histórico*	-1.41	1.07	-2.48

* Datos de octubre 2018 a agosto 2024.

Datos estadísticos (2):		
Volatilidad:	4.11%	
Error de rastreo:	2.27%	
Beta (β) / Alfa (α)	0.6472	0.0039

Valor en Riesgo (a 1 día el 97.5% de confianza):		
VaR (4) y límite de VaR:	1.26%	3.50%
Consumo de VaR	36%	

Algunos datos prácticos

Comisiones anuales (serie B1FI):	0.32%
Administración:	0.27%
Distribución:	0.05%

Como encontrar el fondo:	
ISIN	MX51VA1F0038
Ticker	VALMX34 B1FI

Operación del fondo:	
Liquidez (compra)	Diaria
Liquidez (venta)	Diaria
Plazo liquidación	48 Horas
Horario operación *	De 08:30 a 12:45

* Los horarios pueden cambiar dependiendo de los días y horas hábiles en México, EE.UU. y en Europa.

Rendimientos periodos recientes (tasas efectivas)

	Agosto	Julio	Junio	YTD	3 meses	6 meses
VALMX34 B1FI	5.89	2.16	8.35	2.33	17.21	0.84
Referencia	6.14	2.56	8.39	20.64	17.99	18.58
Diferencia	-0.25	-0.40	-0.04	-18.31	-0.78	-17.74

Rendimientos de largo plazo (tasas efectivas anualizadas)

	12 meses	3 años	5 años	7 años	10 años	Histórico*
VALMX34 B1FI	4.82	-3.73	-2.59			-1.41
Referencia	24.01	2.28	0.94			1.07
Diferencia	-19.19	-6.01	-3.53			-2.48

* Datos de oct-18 a ago-24 de ser necesario se reconstruye la serie B1FI 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	
Mar-2024	-16.0%	Mar-2024	-13.7%	Mar-2020	+23.8%	Ene-2019	+3.2%
May-2020	-7.1%	Nov-2018	-0.7%	Jun-2024	+8.3%	Dic-2018	+1.2%
Nov-2020	-6.3%	Mar-2019	-0.6%	Nov-2021	+6.2%	Mar-2022	+0.3%
Dic-2021	-5.6%	Abr-2024	-0.4%	Ago-2024	+5.9%	Mar-2020	+0.2%
Oct-2020	-4.8%	Jul-2024	-0.4%	Ago-2019	+5.7%	Jun-2022	+0.2%

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



Portafolio

Información al 30 agosto 2024

Distribución por mercado	Referencia	Portafolio
Deuda Moneda Extranjera	-	92.0%
Efectivo / Fondeo	-	8.0%
Distribución por sector (deuda y capitales)		
Gobierno Federal		92.0%
Efectivo / Fondeo		8.0%
Distribución por región (incluye deuda y capitales)		
Norte-América		97.5%
América Latina		2.5%
Distribución por plazo (solo deuda)		
0-3 meses	-	39.1%
3-6 meses	-	25.6%
6-12 meses	-	35.3%
Total deuda (duración bonos en directo 100.0% = 0.4 años)	-	100.0%
Distribución por calificación (solo deuda)		
Fondeo diario		8.0%
Gobierno Federal		92.0%
Total deuda		100.0%
Principales 10 tenencias		
Treasury Bills (Jun-25)		6.7%
Treasury Bills (Jul-25)		6.7%
Treasury Bills (Ago-25)		6.7%
Saldo Efectivo Dólares		5.5%
Treasury Bills (Sep-24)		5.2%
Treasury Bills (Sep-24)		5.2%
Treasury Bills (Oct-24)		5.2%
Treasury Bills (Oct-24)		5.2%
Treasury Bills (Oct-24)		5.2%
Treasury Bills (Nov-24)		5.1%
Total		56.7%

Datos del portafolio	
Emisoras y deversificación	
Número de emisoras	19
Diversificación (1/Herfindahl)	19
Portafolio por monedas	
Pesos	2.5%
UDIs	-
Dólares (EUA)	97.5%
Euros	-

Información adicional	
Posibles adquirientes (sub series):	
Personas Físicas y Personas morales.	
Clasificación y Autorización CNBV:	
Fondo de inversión especializado en Deuda denominada en Dólares. Oficio No. 157/9521/2018 con fecha 30 de noviembre de 2018	

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 (ß) 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