

# SMARTRC

Agosto, 2024



El SMARTRC replica al índice S&P/BMV Bursa Óptimo que busca la creación de un portafolio eficiente que maximice el rendimiento mediante procesos de optimización. Incluye cinco variables fundamentales y dos operativas maximizando el *Sharpe Ratio* del portafolio.

## ¿POR QUÉ INVERTIR EN EL ETF?



1. Acceso a una alternativa de mediano y largo plazo que, en base a su historia, tiene mayores rendimientos que el S&P/BMV IPC.
2. Acceso a una portafolio con estrategia multifactorial y diversificado.
3. Fácil de comprar y vender en el mercado.

Actinver

Asset Management

ETF Multifactor

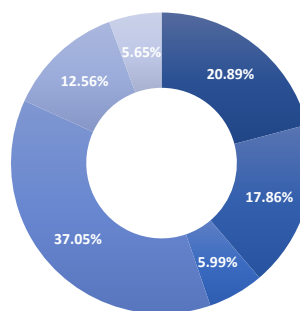
### INFORMACIÓN CLAVE

Clave de Pizarra	SMARTRC 14
Gastos Totales	0.65%
Índice referencia	S&P/BMV Bursa Óptimo
Ticker Bloomberg	VDMEX Index
Horizonte	Mediano/Largo Plazo
Inversionista	Física, Moral
Compras/Ventas	Todos los días hábiles
Liquidación	24 hrs.
Activo Neto (mdp)	\$3 MM

## CARTERA: 10 POSICIONES PRINCIPALES<sup>1</sup>

Identificador	ISIN	Sector	Peso
GMEXICO B	MXP370841019	Materiales	7.08%
BIMBO A	MXP495211262	Cons. Básico	6.68%
GRUMA B	MXP4948K1056	Cons. Básico	6.58%
ASUR B	MX01GA000004	Industrial	5.75%
GAP B	MXP001661018	Industrial	5.49%
AC *	MXP370711014	Cons. Básico	5.29%
FEMSA UBD	MXP225611567	Cons. Básico	5.27%
CEMEX CPO	MX01AC100006	Materiales	4.93%
GFNORTE O	MXP320321310	Financiero	4.83%
WALMEX *	MX01WA000038	Cons. Básico	4.77%
<b>Total</b>			<b>56.67%</b>

## CARTERA POR SECTOR<sup>1</sup>

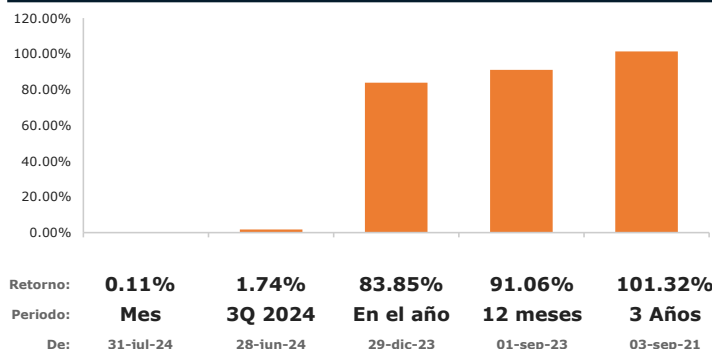


Sector	Peso
Energía	0.00%
Materiales	20.89%
Industrial	17.86%
Cons. Discr.	5.99%
Cons. Básico	37.05%
Salud	0.00%
Financiero	12.56%
Tecnología	0.00%
Comunicaciones	5.65%
Servicios	0.00%
Bienes Raíces	0.00%
<b>Total</b>	<b>100.00%</b>

## EVOLUCIÓN DE UNA INVERSIÓN DE \$1,000.00 MXN<sup>2</sup>



## DESEMPEÑO DEL FONDO AL 30/8/2024



## RENDIMIENTOS MENSUALES

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	AÑO
2024	-0.41%	81.07%	3.21%	0.01%	-0.99%	-1.95%	1.63%	0.11%					83.85%
2023	12.50%	-4.10%	3.19%	1.70%	-4.23%	-1.62%	1.93%	-2.06%	-4.36%	-6.13%	9.03%	6.45%	10.97%
2022	-1.39%	4.12%	3.33%	-6.95%	0.73%	-8.12%	3.21%	-6.48%	-1.49%	11.60%	4.68%	-4.94%	-3.53%
2021	-3.48%	3.24%	5.59%	2.19%	4.66%	-0.15%	0.31%	3.36%	-3.10%	1.34%	-2.49%	4.86%	16.97%

Actinver

Asset Management

Para mayor información, comunícate con Jaime Merino  
jmerino@actinver.com.mx

### Centro de Atención Telefónica (CAT) 55-1103-6699

Donde contratar:

- Banca electrónica (e-Actinver)
- Plataforma inversiones (Bursanet)
- Casa Bolsa / Banco Actinver

Recomendaciones antes de contratar:

- Conocer el índice.
- Conocer las características del ETF.

1. Composición de cartera con información de mercado al cierre del 31/May/2024.  
2. Representa el rendimiento acumulado de \$1,000 MXN calculado con precios teóricos al cierre del 30/Jun/2024.

El precio teórico puede diferir del precio de mercado.  
El desempeño en el pasado puede no ser indicativo del desempeño que tendrá en el futuro. Los resultados pueden ser positivos o negativos.  
Fuente: Actinver Asset Management