

# SMARTRC

Mayo, 2025



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

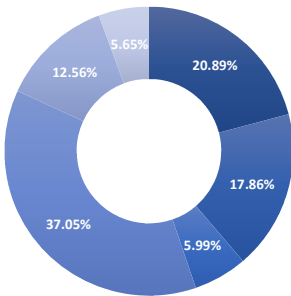
### INFORMACIÓN CLAVE

|                   |                        |
|-------------------|------------------------|
| 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%  |
| Total         |              |              | 56.67% |

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

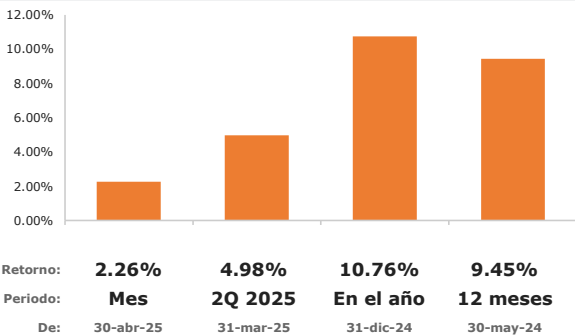


| Sector         | Peso    |
|----------------|---------|
| Energía        | 0.00%   |
| Materiales     | 20.89%  |
| Industrial     | 17.86%  |
| Cons. Discr.   | 5.99%   |
| Cons. Básico   | 37.05%  |
| Salud          | 0.00%   |
| Financiero     | 12.56%  |
| Tecnología     | 0.00%   |
| Comunicaciones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

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



## DESEMPEÑO DEL FONDO AL 30/5/2025



## RENDIMIENTOS MENSUALES

|      | Ene    | Feb    | Mar   | Abr    | May    | Jun    | Jul   | Ago    | Sep    | Oct    | Nov    | Dic    | AÑO    |
|------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2025 | 2.72%  | 1.32%  | 1.38% | 2.66%  | 2.26%  |        |       |        |        |        |        |        | 10.76% |
| 2024 | -0.41% | 81.07% | 3.21% | 0.01%  | -0.99% | -1.95% | 1.63% | 0.11%  | 1.01%  | -1.02% | -0.26% | -0.54% | 82.32% |
| 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 | TRACs

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.

Para mayor información, comunícate con Manuel Sánchez <jmsanchez@actinver.com.mx>

1. Composición de cartera con información de mercado al cierre del 30/5/2025

2. Representa el rendimiento acumulado de \$1,000 MXN calculado con precios de mercado al cierre del 30/5/2025

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 Tracs