



InGenius

# S&P/BMV Ingenius Index (MXN)



## Vehículo

Permite tener acceso a las acciones más cotizadas de tecnología e internet a una fracción de su precio.



## Índice

Construido en conjunto con S&P Dow Jones y BMV.



## Rendimiento

Histórico superior a principales índices en el mercado.

# Criterios del índice

- Listado: NYSE o NASDAQ.
- Empresa debe valer más de 50,000 millones USD.
- Top 12 empresas con mayor potencial de crecimiento según:

-Ganancias por acción  
-Ventas por acción  
-Tasa de crecimiento Interno



**5 años**

# Composición



Sector	Subindustria	Emisora
<b>Consumo Discrecional</b>	Ventas por internet y marketing Directo	AMAZN
<b>Servicios de comunicación</b>	Medios y servicios interactivos	GOOG, META, NFLX
<b>Tecnologías de información</b>	Software de sistemas	MSFT, ORCL
	Equipos tecnológicos, almacenamiento electrónico y periféricos	AAPL
	Procesamiento de datos y servicios subcontratados	V, MA
	Semiconductores	NVDA, QCOM, AMD



## Portafolio

**Costo mayor a  
\$1 millón MXN APROX.**

12 transacciones.

Mayor margen de error  
(transacciones y en ponderación a largo plazo).

Mayor capital = Portafolios  
capital = menos eficientes.



## ETF

Costo ≈ \$60 MXN APROX.

1 sola transacción.

Mismas acciones, mayor  
eficiencia gracias al  
rebalanceo (Momentum).

Menos capital = Portafolios  
capital = más eficientes.

# Rebalanceo

**MOMENTUM:** MÉTODO DE REBALANCEO (PONDERACIÓN)

---



El Momentum es la velocidad a la que cambia el precio



Ayudar a identificar tendencias entre los activos

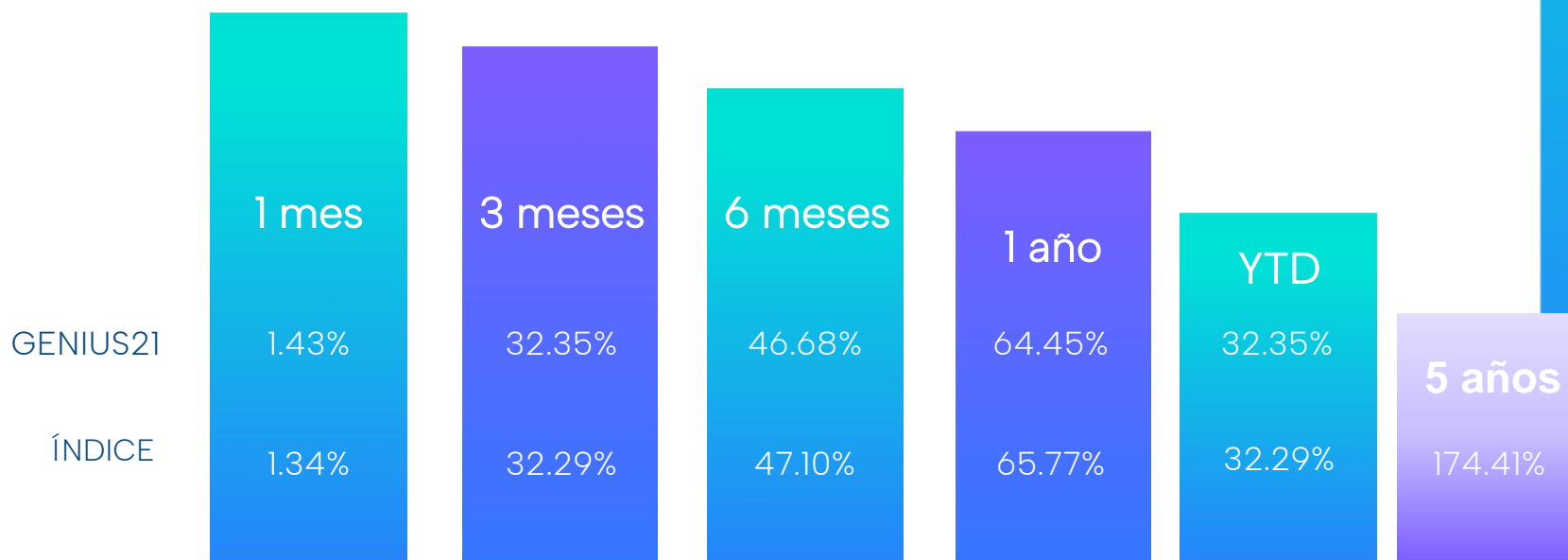


**Mejor Momentum**



**Mayor Ponderación**

## Datos Marzo 2024



Rendimiento efectivo  
**InGenius**



# Información relevante



## Fecha de Recomposición

La composición del Índice es reconstituida anualmente el 3er viernes de Septiembre.



## Fecha de Rebalanceo

El rebalanceo ocurre de manera trimestral el 3er viernes de los siguientes meses:

**Marzo – Junio – Septiembre – Diciembre**

## Market Maker: Intercam Casa de Bolsa

- Robots con posturas de compra y venta que automáticamente estarán dando Mercado
- Haciendo arbitraje con mercado de origen de la canasta para obtener el margen más cerrado

Clave de pizarra:  
**Genius21**

**Comisión de Administración**

**La comisión de Administración es de 60 puntos básicos anuales.**

# Eficiencia fiscal

## ESTATE TAX

Impuesto sobre herencia a instrumentos financieros domiciliados en Estados Unidos, incluyendo acciones en directo adquiridas a través del SIC.



**InGenius ETF se encuentra domiciliado en México, por lo que se encuentra exento del Estate Tax.**

# InGenius ETF

Su core es tecnología: Es la mejor manera de invertir en un concepto similar a las "FAANG" de manera eficiente y diversificada.



**Accesible: Precio aproximado de 60 MXN**



**Sobreponderación en activos calificados con alto potencial de crecimiento**



**Perspectiva positiva del sector**



**Balanceado y diversificado**

# Expectativas del Mercado para InGenius ETF

Emisora	Recomendación			Recomendación			Precio USD 31 27/03/2024	Precio USD Potencial	Rendimiento Potencial 12M	ETF Weight
	BUY	HOLD	SELL	BUY	HOLD	SELL				
Apple	31	19	5	56%	35%	9%	\$ 173.31	\$ 198.53	15%	5.0%
Advanced Micro Devices	46	12	2	77%	20%	3%	\$ 179.59	\$ 199.39	11%	9.2%
Amazon	67	2	0	97%	3%	0%	\$ 179.83	\$ 208.36	16%	5.9%
Alphabet	12	5	0	71%	29%	0%	\$ 151.94	\$ 164.52	8%	5.9%
Mastercard	40	4	0	91%	9%	0%	\$ 477.95	\$ 512.66	7%	5.0%
Meta	63	7	2	88%	10%	3%	\$ 493.86	\$ 529.24	7%	19.7%
Microsoft	62	5	0	93%	7%	0%	\$ 421.43	\$ 469.57	11%	11.1%
Netflix	40	16	3	68%	27%	5%	\$ 613.53	\$ 613.54	0%	5.8%
Nvidia	60	7	0	90%	10%	0%	\$ 902.50	\$ 978.27	8%	20.0%
Oracle	21	14	1	58%	39%	3%	\$ 125.27	\$ 138.23	10%	4.4%
Qualcomm	23	15	2	58%	38%	5%	\$ 169.13	\$ 164.36	-3%	3.3%
Visa	37	8	0	82%	18%	0%	\$ 279.02	\$ 304.63	9%	4.7%

Rendimiento Potencial GENIUS21

8.68%

Precio Esperado GENIUS21

\$ 76.45



# Comparativo ETF's



Michelle Ralph

[mralph@quantashares.com](mailto:mralph@quantashares.com)

Tel. (55) 5033 2460

Whatsapp (998) 240 8594

Atenea Rangel Gómez

[arangel@quantashares.com](mailto:arangel@quantashares.com)

Tel. (55) 5033 3486

WhatsApp (442) 317 0622



@QUANTASHARES



@QUANTASHARES



@QUANTASHARES

QUANTASHARES