

Consulta acerca del requisito del Historial de Operación en los S&P/BMV Indices

CIUDAD DE MÉXICO, JULIO 8, 2019: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) ha iniciado una consulta dirigida a miembros de la comunidad inversionista sobre cambios potenciales en ciertos indicadores de renta variable de la familia S&P/BMV Indices.

Con la intención de expandir el universo de acciones elegibles a los índices manteniendo un umbral razonable respecto al criterio de liquidez, S&P DJI propone modificar el requerimiento del historial de negociación.

Índices	Cambio	Metodología	
		Vigente	Propuesta
S&P/BMV Habita	Historial de Operación	Las series accionarias elegibles no deberán sumar 10 o más días sin operación en los tres meses previos a la fecha de referencia del rebalanceo del índice.	Los valores elegibles deberán contar con un historial de negociación en bolsa de al menos tres meses. Adicionalmente, deberán haberse negociado al menos en el 80% del total de las sesiones de operación en Bolsa durante los 12 meses anteriores a la fecha de referencia del rebalanceo. En el caso de las acciones que cuenten con un historial de negociación menor a 12 meses (como las Ofertas Públicas Iniciales), el citado requerimiento en el historial de negociación se aplicará al historial disponible.
S&P/BMV FIBRAS S&P/BMV IPC Sustentable S&P/BMV de Mediana Capitalización S&P/BMV Índices de Actividad Económica S&P/BMV Índices Sectoriales Invertibles	Historial de Operación	Las series accionarias elegibles no deberán sumar cinco o más días sin operación en los tres meses previos a la fecha de referencia del rebalanceo del índice.	

ANÁLISIS DEL IMPACTO

Con datos al 30 de Abril de 2019, la tabla en la siguiente página muestra el número de componentes actual y la rotación del índice bajo la metodología vigente. Asimismo, se muestran los resultados en el número de componentes y la rotación en el índice bajo la implementación hipotética de los cambios propuestos a la metodología.

Índice	Número de Componentes		Rotación	
	Metodología Vigente	Metodología Propuesta	Metodología Vigente	Metodología Propuesta
S&P/BMV Habita	6	5	22.27920%	31.21886%
S&P/BMV FIBRAS Index	10	10	8.36502%	8.36502%
S&P/BMV IPC Sustentable	30	30	0.49605%	0.49605%
S&P/BMV de Mediana Capitalización	25	26	4.35457%	3.33389%
S&P/BMV Índices de Actividad Económica:				
S&P/BMV Servicios Comerciales (Comercio y Prestación de Servicios)	17	17	2.09573%	2.09573%
S&P/BMV Construye (Construcción)	16	16	2.37128%	2.37128%
S&P/BMV Servicios (Servicios Financieros)	10	10	2.42340%	2.42340%
S&P/BMV Enlace (Infraestructura y Transportes)	12	12	1.56104%	1.56104%
S&P/BMV Transforma (Industria manufacturera, electricidad, gas y agua)	24	26	3.05316%	2.24216%
S&P/BMV Extractiva (Minería y Agricultura)	7	7	0%	0%
S&P/BMV Comercio (Casas Comerciales y Distribuidores)	15	15	4.38472%	4.38472%
S&P/BMV Índices Sectoriales Invertibles:				
S&P/BMV Sector Selectivo Consumo Frecuente	14	14	1.70505%	1.70505%
S&P/BMV Sector Selectivo Financiero	10	10	2.42340%	2.42340%
S&P/BMV Sector Industrial	17	17	1.80027%	1.80027%
S&P/BMV Sector Materiales	12	13	3.86973%	8.42662%

CALENDARIO DE IMPLEMENTACIÓN

En caso de que los cambios a la metodología del índice descritos en este documento fueran adoptados, S&P DJI propone la implementación de los mismos antes de la apertura de mercado del Lunes 23 de Septiembre de 2019.

PREGUNTAS

Responda por favor a las siguientes preguntas y exponga ante S&P DJI sus argumentos:

1. ¿Está de acuerdo con la implementación del cambio propuesto en el requerimiento del Historial de Negociación de los Índices S&P/BMV de Renta Variable?
2. Si respuesta a la pregunta del numeral 1 es afirmativa, ¿a cuáles índices debe aplicarse el requerimiento propuesto para el Historial de Negociación? Seleccione todos los indicadores que considere elegibles.
 - S&P/BMV Habita
 - S&P/BMV FIBRAS
 - S&P/BMV IPC Sustentable
 - S&P/BMV de Mediana Capitalización
 - S&P/BMV Índices de Actividad Económica
 - S&P/BMV Índices Sectoriales Invertibles
3. Si los cambios propuestos en esta consulta debieran aceptarse ¿está Usted de acuerdo con la fecha de implementación propuesta?
4. ¿Tiene algún otro comentario respecto a los cambios propuestos en esta consulta?

Su participación en esta consulta es de suma importancia, pues representa un vehículo para conocer su percepción y preferencias al respecto. S&P DJI pondrá a entera disponibilidad las respuestas a

CONSULTA

esta consulta bajo solicitud.¹ Si no desea revelar su retroalimentación, deberá establecer explícitamente su elección en sus respuestas. Por favor responda a más tardar el **6 de Agosto de 2019**. Después de esta fecha S&P DJI no tomará en cuenta retroalimentación recibida. Antes de que el Comité del Índice concluya la revisión de los comentarios, es posible que S&P DJI contacte a los participantes de esta consulta con el propósito de pedir aclaraciones como parte del proceso de revisión. Opciones alternativas a las preguntas planteadas en esta consulta después de la fecha de cierre implicará una re apertura de la misma

Para participar en línea en esta consulta, responda el cuestionario en inglés disponible [aquí](#).

Para participar en esta consulta en español, envíe sus respuestas a S&P DJI por medio del siguiente correo electrónico: index_services@spglobal.com.

Por favor considere que todos los comentarios serán revisados y tomados en cuenta antes de tomar una decisión final, sin embargo, S&P DJI no garantiza ni tiene obligación alguna de cumplir o hacer efectiva ninguna de las respuestas. Esta consulta pudiera resultar en la ausencia de cambios o resultados de cualquier otro tipo. Si S&P DJI decidiera cambiar la metodología, un anuncio será emitido y publicado en sus respectivos sitios web.

Gracias por completar esta encuesta.

ACERCA DE S&P DOW JONES INDICES

S&P Dow Jones Indices es proveedor de datos, investigación y conceptos acerca de índices, más grande a nivel mundial, así como hogar de indicadores financieros iconos de la industria, como los índices S&P 500[®] y el Dow Jones Industrial Average[®]. Más activos son invertidos en productos basados en nuestros índices que en ningún otro proveedor en el mundo. Desde que Charles Dow inventó el primer índice en 1884, S&P DJI ha innovado y desarrollado índices dentro del espectro de las distintas clases de activos que han definido la forma en que los inversionistas parametrizan y hacen negocios en el mercado.

S&P Dow Jones Indices es una división de S&P Global (NYSE: SPGI), que provee inteligencia financiera esencial a individuos, empresas y gobiernos para una óptima y segura toma de decisiones. Para más información, visite www.spdji.com.

PARA MAYOR INFORMACION:

S&P Dow Jones Indices

index_services@spglobal.com

¹ Los nombres de las compañías así como la información de contacto de los individuos que respondan a esta consulta no serán revelados.