

Resultados de la Consulta sobre el Universo Elegible, Ponderación y Reemplazo de Componentes del Índice S&P/BMV China SX20

CIUDAD DE MEXICO, FEBRERO 19, 2021: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) ha extendido una consulta a la comunidad inversionista sobre la implementación de cambios al índice S&P/BMV China SX20. Con la intención de garantizar que la cuenta objetivo de 20 componentes sea satisfecha, S&P DJI ampliará el Universo del Índice de conformidad con la Opción I propuesta en la consulta.

Asimismo, S&P DJI modificará el esquema de ponderación de acuerdo con la Opción III y agregará a la metodología una regla para el reemplazo de componentes.

Las tablas a continuación resumen los citados cambios.

Universo del Índice	
Vigente	El Universo Elegible está compuesto por todos los ADR's o ADS's chinos de nivel II o III negociados en las Bolsas NYSE y Nasdaq, y que a su vez estén listados en el Sistema Internacional de Cotizaciones de la BMV (SIC).
Actualización	El Universo Elegible está compuesto por todas las acciones domiciliadas en China y que estén a su vez listadas en el Sistema Internacional de Cotizaciones de la BMV (SIC) y en las Bolsas de Estados Unidos (NYSE, Nasdaq y OTC).

Ponderación de Componentes	
Vigente	El índice se pondera en función del Valor de Capitalización de Mercado ajustado por Flotación, limitando la ponderación máxima de cada serie accionaria al 10%.
Actualización	El índice se pondera en función del Valor de Capitalización de Mercado ajustado por Flotación, limitando la ponderación de sus componentes a las siguientes restricciones: <ul style="list-style-type: none"> • La ponderación máxima de cada serie accionaria en el índice no podrá exceder el 15% y • La suma de los pesos de las cinco series accionarias con las ponderaciones más en el índice no podrá exceder el 60%.

Reemplazo de Componentes	
Vigente	Con excepción de las escisiones, no se harán adiciones a los índices entre rebalancesos.
Actualización	<p>Entre rebalancesos semi anuales, las adiciones al índice ocurren únicamente como reemplazo de la eliminación de alguno de los componentes. Cuando una serie accionaria es eliminada del índice, la adición del reemplazo se efectúa de acuerdo al procedimiento a continuación:</p> <p>La serie accionaria en el Universo elegible que no forme parte del índice y que se encuentre en la posición más baja según el ranking por Factor de Bursatilidad y VWAP FMC durante el período de los seis meses previos es elegida para su inclusión al índice. La fecha efectiva para la adición es la misma que la fecha efectiva de la eliminación. La fecha de referencia del Factor de Bursatilidad, para fines de la adición, corresponde a la fecha de referencia usada en el último rebalanceo semi anual. La fecha de referencia del VWAP FMC es siete días antes de la fecha efectiva de la adición.</p> <p>En caso de que dos o más series accionarias que no forman parte del índice obtengan la misma calificación conjunta, la acción con el Valor de Capitalización de Mercado Flotante calculado con el PPP (VWAP FMC) más alto es seleccionada.</p> <p>Con excepción de las escisiones, que son agregadas tomando un precio igual a “cero”, las adiciones se efectúan de acuerdo a la regla de reemplazo de componentes tomando el AWF más alto representado dentro del índice. Si el uso del AWF más alto resultara en un peso que excediera los topes individuales por acción a la fecha en que se anuncia la adición al índice, esta última se efectúa tomando un número de acciones del componente que sea proporcional al peso sujeto al tope máximo de la acción, tomando los precios del cierre de mercado del día en que se anuncia la adición. En estos casos, el número de acciones por componente del índice se mantiene constante.</p>

El proceso de selección del rebalanceo de Marzo de 2021 toma como fecha de referencia el 31 de Enero de 2021. Las actualizaciones a la metodología serán aplicadas al Universo del índice durante el proceso de selección a la fecha de referencia. Con la intención de garantizar que la cuenta objetivo de 20 componentes sea alcanzada, se implementará el reemplazo de componentes al índice. Las acciones que sean agregadas como reemplazo serán efectivas el **Lunes 1 de Marzo de 2021**.

Tenga en cuenta que la Metodología los S&P/BMV Indices publicada en el sitio Web de S&P DJI está siendo actualizada para reflejar este cambio.

Para más información, visite nuestro sitio web www.spdji.com.

ACERCA DE S&P DOW JONES INDICES

S&P Dow Jones Indices es el mayor centro mundial de ideas, datos e investigación basadas en índices. Es, además, la cuna de emblemáticos indicadores del mercado, como el S&P 500® y el Dow Jones Industrial Average®. Existen más activos invertidos en productos vinculados a nuestros índices que en los productos de cualquier otro proveedor en el mundo. Desde que Charles Dow creó el primer índice en 1884, S&P DJI se ha dedicado a la innovación y desarrollo de índices dentro de diversas clases de activos, ayudando a definir la manera en que los inversionistas miden los mercados y operan en ellos.

S&P Dow Jones Indices es una subsidiaria de S&P Global (NYSE: SPGI), que proporciona la información fundamental que personas, empresas y gobiernos necesitan para tomar decisiones con confianza. Para más información, visite www.spdji.com.

PARA MAYOR INFORMACIÓN:

S&P Dow Jones Indices
index_services@spglobal.com

ANUNCIO DEL ÍNDICE