

Índices de ODS de S&P DJI

Los Índices de Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de S&P DJI buscan medir el rendimiento de valores de renta variable elegibles a partir de los índices subyacentes, seleccionados y ponderados para mejorar colectivamente la adecuación a los 17 ODS de las Naciones Unidas y reducir la huella de carbono a nivel de los índices.

¿Cómo funciona el índice?



¿Qué distingue a los índices de ODS?

Datos

S&P DJI ha colaborado con un proveedor de datos especializado, Impact Cubed, cuyos datos:

- Se adecuan a los ODS y son determinados mediante operaciones, productos y servicios de las empresas.
- Son detallados y cubren más de 40,000 emisores y mapas de ingresos de 2,600 actividades.
- Identifican empresas que se alinean positiva y negativamente con los ODS en relación con operaciones de inversión, productos y servicios.

Enfoque de construcción

La metodología aplica la optimización glass-box de S&P DJI para minimizar las desviaciones con respecto al índice subyacente, al tiempo que integra los ODS y los conjuntos de datos sobre carbono para alcanzar múltiples objetivos.

Objetivos del índice

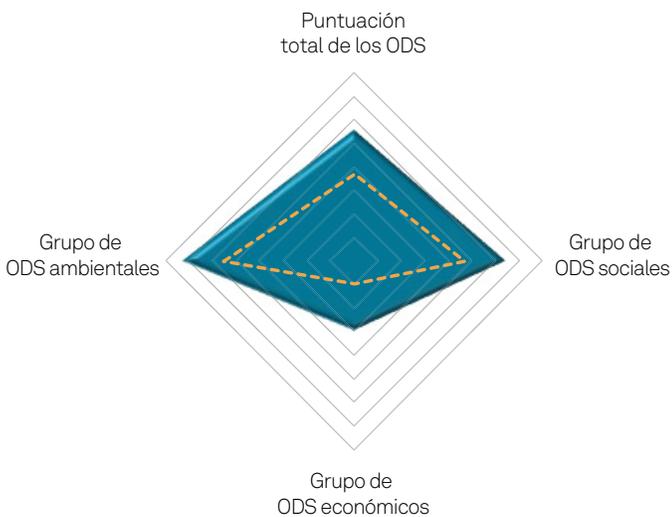
- Alcanzar una mayor adecuación a los ODS que el índice subyacente mediante las actividades y operaciones de los componentes.
- Reducir la cantidad de ingresos ajustados negativamente a los ODS en comparación con el índice subyacente.
- Disminuir la huella de carbono y la intensidad de las emisiones de gases de efecto invernadero en comparación con el índice subyacente.

Los grupos de ODS

Sociedad	Economía	Ambiente
1 Fin de la pobreza	8 Trabajo decente y crecimiento económico	13 Acción por el clima
2 Hambre cero	9 Industria, innovación e infraestructura	14 Vida submarina
3 Salud y bienestar	10 Reducción de las desigualdades	15 Vida de ecosistemas terrestres
4 Educación de calidad	12 Producción y consumo responsables	
5 Igualdad de género	17 Alianzas para lograr los objetivos	
6 Agua limpia y saneamiento		
7 Energía asequible y no contaminante		
11 Ciudades y comunidades sostenibles		
16 Paz, justicia e instituciones sólidas		

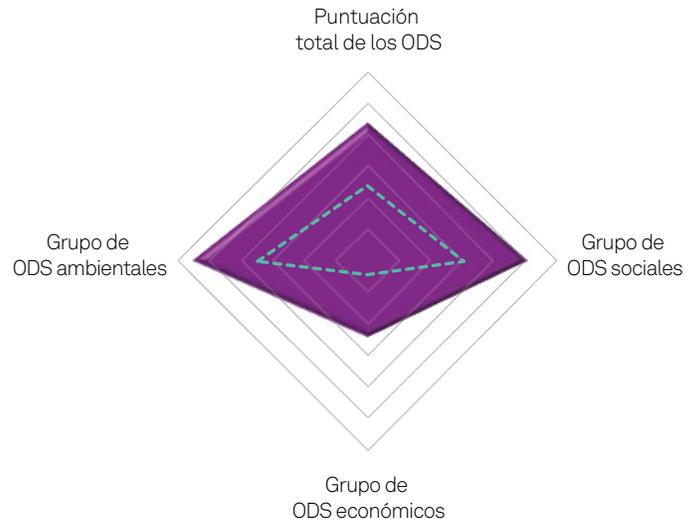
Adecuación de la operaciones*

S&P 500 SDG Index



— S&P 500® SDG Index
- - - S&P 500

S&P Global LargeMidCap SDG Index



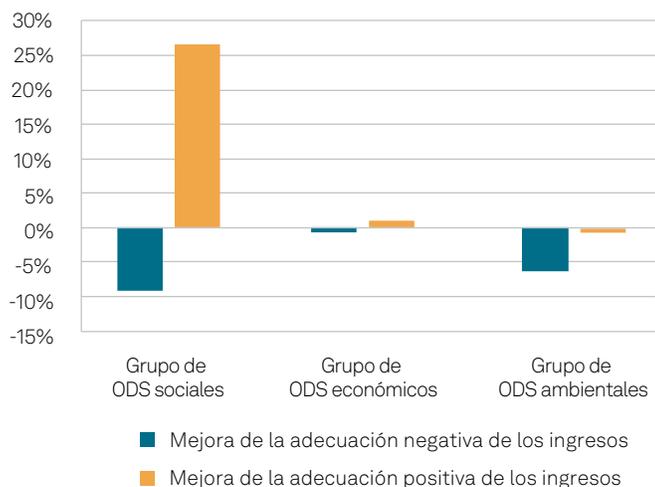
— S&P Global LargeMidCap SDG Index
- - - S&P Global LargeMidCap Index

*La adecuación de las operaciones se calcula como el promedio ponderado de las puntuaciones totales de ODS o puntuaciones grupales de ODS.

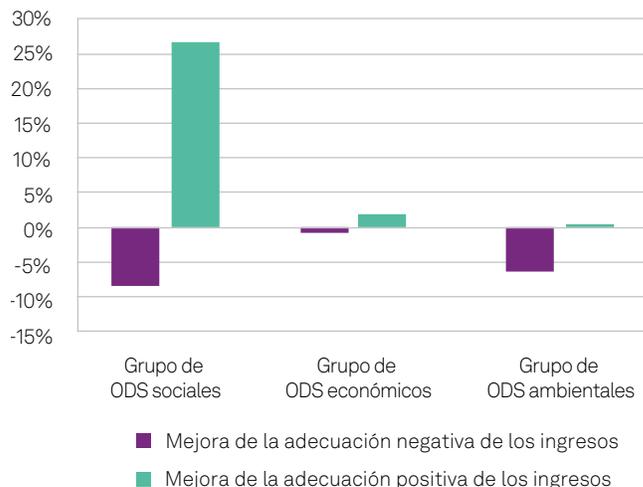
Fuente: S&P Dow Jones Indices LLC. Datos al 17 de noviembre de 2023. El S&P 500 SDG Index y el S&P Global LargeMidCap SDG Index fueron lanzados el 18 de diciembre de 2023. Todos los datos presentados antes de la fecha de lanzamiento son hipotéticos y generados mediante pruebas retrospectivas. El desempeño pasado no garantiza resultados futuros. Estos gráficos poseen fines ilustrativos y reflejan un rendimiento histórico hipotético. Por favor, consulte la Divulgación de desempeño al final de este documento para más información sobre las limitaciones del desempeño generado mediante pruebas retrospectivas.

Adecuación de los ingresos**

S&P 500 SDG Index



S&P Global LargeMidCap SDG Index



**La adecuación de las operaciones se calcula según se especifica en la metodología del índice, y la mejora es la diferencia entre la adecuación de ingresos del índice de ODS de S&P DJI frente al índice subyacente. La mejora de los ODS individuales no constituye una meta en la metodología del índice.

Fuente: S&P Dow Jones Indices LLC. Datos al 17 de noviembre de 2023. El S&P 500 SDG Index y el S&P Global LargeMidCap SDG Index fueron lanzados el 18 de diciembre de 2023. Todos los datos presentados antes de la fecha de lanzamiento son hipotéticos y generados mediante pruebas retrospectivas. El desempeño pasado no garantiza resultados futuros. Estos gráficos poseen fines ilustrativos y reflejan un rendimiento histórico hipotético. Por favor, consulte la Divulgación de desempeño al final de este documento para más información sobre las limitaciones del desempeño generado mediante pruebas retrospectivas.

Desempeño retrospectivo histórico del índice de ODS frente al índice de referencia

Métrica	S&P 500	S&P 500 SDG Index	S&P Global LargeMidCap	S&P Global LargeMidCap SDG Index
Número de componentes	503	331	3,507	1,246
Rendimiento anualizado a 3 años (%)	9.8	9.9	6.0	5.7
Desviación estándar a 3 años (%)	17.5	18.7	16.3	17.2
Rendimiento ajustado por riesgo a 3 años	0.56	0.53	0.37	0.33
Adecuación positiva de los ingresos a los ODS (%)	28	56	21	50
Adecuación negativa de los ingresos a los ODS (%)	17	0	16	0
Puntuación operacional de los ODS	-0.33	-0.16	-0.16	0.03
WACI de alcance 1 y 2***	30.9	9.9	55.9	20.2
WACI de alcance 1, 2 y 3***	297.5	92.8	463.2	192.4
Active share (%)		25		30
Tracking error (%)		2.41		2.01

***WACI es la sigla de promedio ponderado de la intensidad de carbono en inglés.

Fuente: S&P Dow Jones Indices LLC. Datos al 17 de noviembre de 2023. Los rendimientos anualizados, la desviación estándar y los rendimientos ajustados por riesgo son del 30 de noviembre de 2023. El S&P 500 SDG Index y el S&P Global LargeMidCap SDG Index fueron lanzados el 18 de diciembre de 2023. Todos los datos presentados antes de la fecha de lanzamiento son hipotéticos y generados mediante pruebas retrospectivas. El desempeño pasado no garantiza resultados futuros. Esta tabla tiene fines ilustrativos y refleja un rendimiento histórico hipotético. Por favor, consulte la Divulgación de desempeño al final de este documento para más información sobre las limitaciones del desempeño generado mediante pruebas retrospectivas.

Acerca de S&P Dow Jones Índices

En S&P Dow Jones Índices, proporcionamos soluciones de índices icónicos e innovadores respaldadas por una experiencia inigualable en las diferentes clases de activos. Al brindar transparencia a los mercados de capitales internacionales, ayudamos a los inversionistas de todo el mundo a tomar decisiones con convicción. Somos la mayor fuente mundial de conceptos, datos e investigación con base en índices, así como el hogar de indicadores icónicos del mercado financiero, como el S&P 500® y el Dow Jones Industrial Average®. Existen más activos invertidos en productos basados en nuestros índices que en los de cualquier otro proveedor de índices del mundo. Con más de US\$ 8.3 billones en activos de gestión pasiva vinculados a nuestros índices y más de US\$ 8.4 billones invertidos en referencia a nuestros índices, nuestras soluciones son ampliamente consideradas esenciales para el seguir del rendimiento del mercado, la evaluación de carteras y el desarrollo de estrategias de inversión.

S&P Dow Jones Índices es una división de S&P Global (NYSE: SPGI). S&P Global es el principal proveedor mundial de calificaciones crediticias, índices de referencia, análisis de datos y soluciones de flujo de trabajo en los mercados mundiales de capitales, commodities y automóviles. Con cada una de nuestras soluciones, ayudamos a muchas de las empresas más importantes del mundo a desenvolverse en el entorno económico para que puedan planificar su futuro hoy. Para más información, visite www.spglobal.com/spdji/es.

CONTÁCTENOS

EE. UU.

+1-877-325-5415

EMEA

+44-20-7176-8888

EAU

+971(0)4-371-7131

Asia Pacífico

+86-10-6569-2770

India

+91-22-2272-5312

Japón

+81 3-4550-8564

Australia

+61 2-9255-9802

América Latina

+52 55-1037-5290

Sudáfrica

+27-11214-1994

© 2024 S&P Dow Jones Índices. Todos los derechos reservados. Se prohíbe la redistribución o reproducción total o parcial sin autorización previa por escrito de S&P Dow Jones Índices LLC. S&P, S&P 500, SPX, SPY, The 500, US500, US 30, S&P 100, S&P COMPOSITE 1500, S&P 400, S&P MIDCAP 400, S&P 600, S&P SMALLCAP 600, S&P GIVI, GLOBAL TITANS, DIVIDEND ARISTOCRATS, Select Sector, S&P MAESTRO, S&P PRISM, S&P STRIDE, GICS, SPIVA, SPDR, INDEXOLOGY, iTraxx, iBoxx, ABX, ADBI, CDX, CMBX, LCDX, MBX, MCDX, PRIMEX, TABX, HHPI, IRXX, I-SYND, SOVX, CRITS y CRITR son marcas comerciales registradas de S&P Global, Inc. ("S&P Global") o sus asociadas; DOW JONES es una marca registrada de Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"); y estas marcas han sido licenciadas para su uso por S&P Dow Jones Índices LLC (o S&P DJI). S&P Dow Jones Índices LLC, Dow Jones, S&P Global y sus respectivas afiliadas (en conjunto "S&P Dow Jones Índices") no entregan ninguna garantía, explícita o implícita, con respecto a la capacidad de cualquier índice para representar con precisión la clase de activos o sector del mercado que pretende representar y S&P Dow Jones Índices y sus licenciantes externos no serán responsables por ningún error, omisión o interrupción de algún índice o de la información involucrada. Toda la información es proporcionada por S&P DJI "en el estado en que se encuentra". El rendimiento pasado no es señal o garantía de resultados futuros. Por favor revise la Divulgación de desempeño en www.spglobal.com/spdji/es/disclaimers/#performance-disclosure para más información sobre las limitaciones del desempeño hipotético y/o generado mediante pruebas retrospectivas. Este documento no constituye una oferta de servicios. Con excepción de algunos servicios de cálculo de índices personalizados, toda la información proporcionada por S&P Dow Jones Índices es de naturaleza general y no está adaptada a las necesidades de ninguna persona, entidad o grupo de personas. S&P Dow Jones Índices recibe retribución relacionada con el otorgamiento de licencias de sus índices a terceros y la entrega servicios de cálculo personalizados. No es posible invertir directamente en un índice. La exposición a una clase de activos representada por un índice puede estar disponible por medio de instrumentos de inversión que ofrezcan terceras partes con base en ese índice. S&P Dow Jones Índices no patrocina, avala, vende, promueve o administra ningún fondo de inversión ni otros productos de inversión y que busquen proporcionar un rendimiento sobre la inversión basado en el comportamiento de cualquier índice. S&P Dow Jones Índices LLC no es un asesor de inversiones, de operaciones de commodities ni un asesor tributario. S&P Dow Jones Índices no hace ninguna declaración relacionada con la conveniencia de invertir en ninguno de tales fondos de inversión u otros productos o vehículos de inversión. S&P Dow Jones Índices mantiene ciertas actividades de sus unidades comerciales separadas unas de otras con el fin de preservar la independencia y objetividad de sus actividades respectivas. En consecuencia, ciertas funciones de S&P Dow Jones Índices pueden contar con información que no está disponible para otras unidades comerciales. Para más información sobre cualquiera de nuestros índices, visite www.spglobal.com/spdji/es.

Este documento ha sido traducido al español únicamente por propósitos de conveniencia. Si existieran diferencias entre las versiones en inglés y español, la versión en inglés prevalecerá. El documento en inglés está publicado en www.spglobal.com/spdji.