

Índice S&P 500® ESG

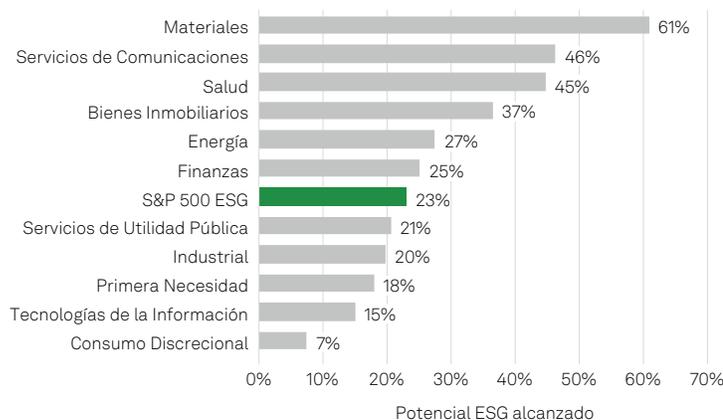
Integrando los valores ESG al núcleo de las inversiones

El índice S&P 500 ESG entrega una representación mejorada de la sostenibilidad y mantiene un perfil de riesgo/rendimiento similar al del S&P 500.

El índice clasifica y selecciona empresas elegibles usando las puntuaciones ESG de S&P DJI y varias exclusiones de sostenibilidad. Su composición apunta a 75% de la capitalización de mercado de cada grupo industrial GICS® del S&P 500.

Las puntuaciones ESG de S&P DJI son únicas porque se centran en las señales de sostenibilidad más importantes y con mayor relevancia financiera dentro de industrias específicas. Estas puntuaciones son gobernadas por S&P DJI y calculadas por S&P Global ESG Research.

Potencial ESG alcanzado por sector vs benchmark



Fuente: S&P Dow Jones Indices LLC. Datos al 31 de julio de 2023.

La "mejora compuesta de la puntuación ESG" por sector y por índice se calcula como la diferencia porcentual entre las puntuaciones ESG totales del índice/sector del S&P 500 ESG y del S&P 500, en relación con la máxima mejora ESG posible del índice/sector y con base en una inversión solamente en la empresa de mayor puntuación ESG dentro del índice/sector. El S&P 500 ESG Index fue lanzado el 28 de enero de 2019. Todos los datos presentados antes de la fecha de lanzamiento son hipotéticos y generados mediante pruebas retrospectivas. El desempeño pasado no garantiza resultados futuros. Estas tablas y gráficos poseen un fin ilustrativo y reflejan desempeños históricos hipotéticos. Por favor, consulte la Divulgación de desempeño al final de este documento para más información sobre las limitaciones del desempeño generado mediante pruebas retrospectivas.



Medidas de la mejora en la puntuación ESG

Medida	S&P 500	Índice S&P 500 ESG
Mejora en la puntuación ESG (%)	-	7.94
Potencial ESG alcanzado (%)	-	23.00

Datos al 31 de julio de 2023.

Desempeño del índice S&P 500 ESG vs el benchmark

Medida	S&P 500	Índice S&P 500 ESG
Núm. de componentes	503	321
Rendimientos anualizados de 5 años (%)	12.20	13.94
Desviación estándar de 5 años (%)	18.8	18.90
Rendimientos ajustados por riesgo de 5 años	0.65	0.74
Tracking Error (%)	-	1.35

Datos al 31 de julio de 2023.

Algunos ejemplos de los beneficios del índice S&P 500 ESG



Ambientales

19%

mayor exposición a empresas que han informado públicamente sus indicadores medioambientales cuantitativos y recibieron una garantía externa respecto de sus informes medioambientales.



Sociales

12%

mayor exposición a empresas que cuentan con una política de compromiso con el respeto a los derechos humanos de acuerdo con los Principios Rectores sobre las empresas y los derechos humanos de las Naciones Unidas (u otros), un proceso de debida diligencia para identificar y evaluar de forma proactiva los posibles impactos y riesgos relacionados con el respeto de los derechos humanos y que han informado públicamente sus acciones de mitigación y reparación en materia de derechos humanos.



Gobernanza y economía

14%

mayor exposición a empresas que no están envueltas en ninguna investigación en desarrollo relacionada con prácticas anticompetitivas, que tienen una política anticorrupción y antisoborno disponible públicamente y que han divulgado sus contribuciones políticas y benéficas públicamente, además de no haber estado involucradas en ningún caso de corrupción o soborno en desarrollo en los últimos cuatro años.

12%

mayor exposición a empresas que han integrado los problemas relacionados con el clima a su gestión de riesgos, han identificado riesgos y oportunidades climáticas, han informado sobre sus actividades para reducir las emisiones de carbono, proporcionan productos bajos en carbono o han facilitado que un tercero evite emitir GEI, y han creado iniciativas para alcanzar las emisiones netas cero (net zero).

12%

mayor exposición a empresas que han divulgado el tipo y cobertura de las evaluaciones de desempeño individuales usadas para la compensación relacionada con el desempeño, que han entregado incentivos a largo plazo a los empleados y han aplicado un enfoque reconocido y con una escala para medir a los empleados con un compromiso activo.

14%

mayor exposición a empresas que cuentan con procesos para evitar interrupciones de los sistemas de TI, que han implementado políticas para que todos los empleados conozcan las posibles amenazas y que han gestionado con éxito los riesgos de seguridad de la información/ciberseguridad durante los últimos tres años.

10%

mayor exposición a empresas que informan públicamente sus emisiones de CO₂e_q de alcances 1 y 2, su consumo de agua, energía y producción de residuos y residuos peligrosos.

11%

mayor exposición a empresas que informan a los clientes sobre protección de la privacidad y ofrecen la posibilidad de decidir cómo se recopilan, utilizan, conservan y procesan los datos privados, incluyendo el consentimiento opcional, el acceso, la transferencia y eliminación de datos, así como el tiempo de conservación de los mismos.

13%

mayor exposición a empresas que potencian una cultura de riesgo eficaz en todas sus organizaciones, que han identificado riesgos emergentes a largo plazo con un impacto significativo sobre sus actividades comerciales en el futuro, que han tomado medidas de mitigación teniendo en cuenta estos riesgos y que realizan análisis de sensibilidad y pruebas de tensión, incluyendo los riesgos del cambio climático y la disponibilidad/calidad del agua.

Fuente: S&P Dow Jones Indices LLC. Estas son solo algunas de las numerosas maneras en que el índice S&P 500 ESG ofrece una representación ESG mejorada. Una mayor exposición del índice a cada tema ESG en las medidas presentadas arriba se calcula usando los datos del nivel de las preguntas de las Evaluaciones de sostenibilidad corporativa de S&P Global (año metodológico 2022). Estas medidas se calculan usando datos de índices correspondientes al 31 de mayo de 2023, como la diferencia porcentual entre el desempeño del S&P 500 ESG y sus componentes subyacentes en las distintas medidas, considerando promedios ponderados. Este gráfico posee fines ilustrativos.

Acerca de S&P Dow Jones Indices

En S&P Dow Jones Indices, 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 Indices 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

© 2023 S&P Dow Jones Indices. Todos los derechos reservados. Se prohíbe la redistribución o reproducción total o parcial sin autorización previa por escrito de S&P Dow Jones Indices LLC. S&P es una marca comercial registrada de S&P Global, Inc. ("S&P Global") o sus filiales; DOW JONES es una marca comercial registrada de Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"). El uso de estas marcas se ha otorgado bajo licencia a S&P Dow Jones Indices LLC (S&P DJI). S&P Dow Jones Indices LLC, Dow Jones, S&P Global y sus respectivas filiales (en conjunto "S&P Dow Jones Indices") 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 Indices 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 un indicador 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 Indices es de naturaleza general y no está adaptada a las necesidades de ninguna persona, entidad o grupo de personas. S&P Dow Jones Indices recibe retribución relacionada con el otorgamiento de licencias de sus índices a terceros y la entrega de 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 ofrecidos por terceros con base en ese índice. S&P Dow Jones Indices 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 Indices LLC no es un asesor tributario o de inversiones. S&P Dow Jones Indices no hace ninguna declaración relacionada con la conveniencia de invertir en ninguno de tales fondos de inversión u otros productos o vehículos de inversión. Se debería consultar a un asesor tributario para evaluar el impacto de cualquier título exento de impuestos en carteras y las consecuencias tributarias de tomar cualquier decisión de inversión. S&P Dow Jones Indices 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 unidades comerciales de S&P Dow Jones Indices 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.