

Consulta sobre los requisitos de elegibilidad de los S&P/BMV ESG Indices

ÁMSTERDAM, 28 DE FEBRERO, 2022: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) está llevando a cabo una consulta con participantes del mercado sobre posibles cambios en los BMV IPC ESG Tilted Indices, S&P/BMV Total Mexico ESG Index, y en el S&P/BMV IPC CompMX Trailing Income Equities ESG Tilted Index. S&P DJI propone hacer cambios en los requisitos de elegibilidad utilizados en este índice. Los cambios propuestos están detallados a continuación.

EXCLUSIONES BASADAS EN LAS ACTIVIDADES COMERCIALES

S&P DJI propone incorporar exclusiones adicionales, ampliadas y modificadas con base en el involucramiento de una empresa en ciertas actividades comerciales definidas. Las exclusiones adicionales incluyen las arenas petrolíferas, las armas ligeras y la contratación militar; las exclusiones ampliadas incluyen las armas convencionales; y las exclusiones modificadas incluyen el tabaco. Estos cambios se proponen a raíz de los comentarios recibidos sobre nuestras exclusiones actuales. Además, las exclusiones de participación significativa ya no se aplicarán a las categorías en las que el umbral del nivel directo de involucramiento no sea cero. Este cambio propuesto tiene como objetivo evitar situaciones en que las empresas podrían terminar siendo tratadas más severamente por su nivel de involucramiento indirecto que por su involucramiento directo. La siguiente tabla detalla los cambios:

Involucramiento en el producto	Categoría de involucramiento y descripción	Umbral de nivel de involucramiento de S&P DJI		Umbral de participación significativa de S&P DJI		Resumen
		Actual	Propuesto	Actual	Propuesto	
Armas convencionales	Hecho a la medida y fundamental: la empresa está involucrada en el sistema central del arma, o en los componentes /servicios del sistema central del arma, los cuales se consideran hechos a la medida y fundamentales para el uso letal del arma.	>0%	>0%	≥25%	≥25%	Sin cambios
	No hechos a medida o no fundamentales: la empresa proporciona componentes/servicios para el sistema central del arma, los cuales no se consideran hechos a medida o no son fundamentales para el uso letal del arma.	N/A	>0%	N/A	≥25%	Nuevo
Carbón térmico	Extracción: la empresa extrae carbón térmico.	≥5%	≥5%	N/A	N/A	Sin cambios
	Generación de energía: la empresa genera electricidad a partir del carbón térmico.	≥5%	≥5%	N/A	N/A	Sin cambios

Involucramiento en el producto	Categoría de involucramiento y descripción	Umbral de nivel de involucramiento de S&P DJI		Umbral de participación significativa de S&P DJI		Resumen
		Actual	Propuesto	Actual	Propuesto	
Productos de tabaco	Producción: la empresa manufactura productos de tabaco.	>0%	>0%	≥25%	≥25%	Sin cambios
	Productos/servicios relacionados: la empresa proporciona productos/servicios relacionados con tabaco.	≥10%	≥5%	≥25%	N/A	Cambio
	Venta minorista: la empresa recibe ingresos por la distribución y/o venta minorista de productos de tabaco.	≥10%	≥5%	≥25%	N/A	Cambio
Arenas petrolíferas	Extracción: la empresa extrae arenas petrolíferas.	N/A	≥5%	N/A	N/A	Nuevo
Armas ligeras	Clientes civiles (armas de asalto): la empresa fabrica y vende armas de asalto a clientes civiles.	N/A	>0%	N/A	≥25%	Nuevo
	Clientes civiles (armas que no son de asalto): la empresa fabrica y vende armas ligeras (armas que no son de asalto) a clientes civiles.	N/A	>0%	N/A	≥25%	Nuevo
	Clientes militares/fuerzas de orden y seguridad: la empresa fabrica y vende armas ligeras a militares/fuerzas de orden y seguridad.	N/A	>0%	N/A	≥25%	Nuevo
	Componentes clave: la empresa fabrica y vende componentes clave de armas ligeras.	N/A	>0%	N/A	≥25%	Nuevo
	Venta minorista/distribución (armas de asalto): la empresa está involucrada en la venta minorista y/o la distribución de armas de asalto.	N/A	≥5%	N/A	N/A	Nuevo
	Venta minorista/distribución (armas que no son de asalto): la empresa está involucrada en la venta minorista y/o la distribución de armas ligeras (armas que no son de asalto).	N/A	≥5%	N/A	N/A	Nuevo
Contratación militar	Armas: la empresa fabrica sistemas de armas miliares y/o componentes esenciales de estas armas hechos a la medida.	N/A	≥10%	N/A	N/A	Nuevo
	Productos y servicios relacionados con armas: la empresa ofrece productos y/o servicios hechos a la medida que promueven las armas militares.	N/A	≥10%	N/A	N/A	Nuevo

VERIFICACIÓN DE ELEGIBILIDAD TRIMESTRAL DEL INVOLUCRAMIENTO COMERCIAL Y LAS EXCLUSIONES BASADAS EN EL PMNU

S&P DJI propone incorporar una verificación de elegibilidad trimestral para el S&P/BMV Total Mexico ESG Index¹, mediante la cual cualquier miembro del índice que no cumpla con los criterios de elegibilidad de involucramiento comercial o según el Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), será eliminado del índice. El objetivo de esta propuesta es garantizar que cualquier cambio en la elegibilidad de una empresa sea manejado de manera oportuna. Ningún componente será agregado al índice como consecuencia de cualquier eliminación que pueda ocurrir.

ANÁLISIS DE LAS REPERCUSIONES

Si los cambios propuestos hubieran estado vigentes durante el último rebalanceo del índice correspondiente, el universo de elegibilidad de cada indicador hubiera permanecido sin cambios.

FECHA DE IMPLEMENTACIÓN

S&P DJI propone implementar los cambios metodológicos anteriormente descritos (si se aprueban) junto con el rebalanceo de junio de 2022, que entrará en vigor antes de la apertura del mercado el lunes 20 de junio de 2022. Si se aprueban, los cambios serán visibles para los clientes a partir del viernes 10 de junio de 2022.

PREGUNTAS

Por favor responda las siguientes preguntas y proporcione a S&P DJI razones para sus respuestas:

- 1. ¿Está de acuerdo con la propuesta descrita de ampliar y modificar las exclusiones basadas en las actividades comerciales?**
- 2. ¿Está de acuerdo con la propuesta de incorporar una verificación de elegibilidad trimestral de la participación comercial y las exclusiones según el PMNU en el S&P/BMV Total Mexico ESG Index?**
- 3. Si se adopta alguno de los cambios propuestos, ¿está de acuerdo con la fecha de implementación propuesta?**
- 4. ¿Tiene algún otro comentario con respecto a los cambios propuestos descritos en este documento?**

Su participación en esta consulta es importante ya que recolectamos información de varios participantes del mercado para evaluar adecuadamente sus puntos de vista y preferencias. Por favor responda esta encuesta hasta el **25 de marzo de 2022**. Después de esta fecha, S&P DJI ya no aceptará más respuestas de esta encuesta. Antes de la revisión final por parte de la Comisión del índice, S&P DJI puede solicitar aclaraciones a los encuestados como parte de esa revisión.

Para participar en esta consulta, por favor visite la encuesta en línea que está disponible [aquí](#).

Para obtener más información acerca de esta consulta, por favor contacte a S&P Dow Jones Indices mediante el correo electrónico SPDJI_Index_Governance@spglobal.com.

Todos los comentarios de esta consulta serán analizados y considerados antes de tomar una decisión final. No obstante, S&P DJI no ofrece garantías ni tiene ninguna obligación de cumplir con cualquiera

¹ Esta propuesta es únicamente para los S&P/BMV IPC ESG Tilted Indices y el S&P/BMV IPC CompMX Trailing Income Equities ESG Tilted Index, debido a que este grupo de indicadores ya se encuentran sujetos a un programa trimestral de reconstitución

de las respuestas. Es posible que la encuesta no genere ningún tipo de cambio o resultado. Si S&P DJI decide cambiar la metodología del índice, se publicará un anuncio en nuestro sitio web.

Gracias por darse el tiempo de completar esta encuesta.

Para más información sobre S&P Dow Jones Indices, por favor visite www.spglobal.com/spdji.

SOBRE S&P DOW JONES INDICES

S&P Dow Jones Indices es el mayor centro global de ideas, datos e investigación esenciales con base 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.spglobal.com/spdji.

PARA MÁS INFORMACIÓN:

S&P Dow Jones Indices

index_services@spglobal.com

CONSULTA