

## Consulta sobre los requisitos de elegibilidad del índice S&P/BMV ESG – Resultados

**ÁMSTERDAM, 1 DE ABRIL DE 2022:** S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) ha llevado a cabo una [consulta](#) con participantes del mercado sobre posibles cambios en los S&P/BMV IPC ESG Tilted Indices, el S&P/BMV Total Mexico ESG Index y en el S&P/BMV IPC CompMX Trailing Income Equities Tilted Index.

S&P DJI aplicará cambios a los requisitos de elegibilidad utilizados en este índice. Los cambios se detallan a continuación.

### EXCLUSIONES BASADAS EN LAS ACTIVIDADES COMERCIALES

S&P DJI incorporará exclusiones adicionales, ampliadas y modificadas, en función de la participación de una empresa en determinadas actividades comerciales definidas. Las exclusiones adicionales incluyen las arenas petrolíferas, las armas pequeñas 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.

Adicionalmente, 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 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
		Anterior	Actualizado	Anterior	Actualizado	
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 cambio
	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/D	>0%	N/D	≥25%	Nuevo
Carbón térmico:	Extracción: la empresa extrae carbón térmico.	≥5%	≥5%	N/D	N/D	Sin cambio
	Generación: la empresa genera electricidad a partir del carbón térmico.	≥5%	≥5%	N/D	N/D	Sin cambio

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
		Anterior	Actualizado	Anterior	Actualizado	
Productos de tabaco	Producción: la empresa manufactura productos de tabaco.	>0%	>0%	≥25%	≥25%	Sin cambio
	Productos/servicios relacionados: la empresa proporciona productos/servicios relacionados con tabaco.	≥10%	≥5%	≥25%	N/D	Modificación
	Venta minorista: la empresa recibe ingresos por la distribución y/o venta minorista de productos de tabaco.	≥10%	≥5%	≥25%	N/D	Modificación
Arenas petrolíferas	Extracción: la empresa extrae arenas petrolíferas.	N/D	≥5%	N/D	N/D	Nuevo
Armas pequeñas	Clientes civiles (armas de asalto): la empresa fabrica y vende armas de asalto a clientes civiles.	N/D	>0%	N/D	≥25%	Nuevo
	Clientes civiles (armas que no son de asalto): la empresa fabrica y vende armas pequeñas (armas que no son de asalto) a clientes civiles.	N/D	>0%	N/D	≥25%	Nuevo
	Clientes militares/fuerzas de orden y seguridad: la empresa fabrica y vende armas pequeñas a militares/fuerzas de orden y seguridad.	N/D	>0%	N/D	≥25%	Nuevo
	Componentes clave: la empresa fabrica y vende componentes clave de armas pequeñas.	N/D	>0%	N/D	≥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/D	≥5%	N/D	N/D	Nuevo
	Venta minorista/distribución (armas que no son de asalto): la empresa está involucrada en la venta minorista y/o la distribución de armas pequeñas (armas que no son de asalto).	N/D	≥5%	N/D	N/D	Nuevo
Contratación militar	Armas: la empresa fabrica sistemas de armas miliares y/o componentes esenciales de estas armas hechos a la medida.	N/D	≥10%	N/D	N/D	Nuevo
	Productos y servicios relacionados con armas: la empresa ofrece productos y/o servicios hechos a la medida que promueven las armas militares.	N/D	≥10%	N/D	N/D	Nuevo

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

S&P DJI incorporará una verificación de elegibilidad trimestral para el **S&P/BMV Total Mexico ESG Index**<sup>1</sup>, 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.

### **FECHA DE IMPLEMENTACIÓN**

S&P DJI implementará los cambios metodológicos anteriormente descritos junto con el próximo rebalanceo, que entrará en vigor antes de la apertura del mercado el lunes 20 de junio de 2022. Los cambios serán visibles por primera vez para los clientes a partir del viernes 10 de junio de 2022.

Tenga en cuenta que la metodología en el sitio web de S&P DJI está siendo actualizada para reflejar estos cambios.

Para más información acerca de S&P Dow Jones Indices, visite [www.spglobal.com/spdji/es](http://www.spglobal.com/spdji/es).

### **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<sup>®</sup> y el Dow Jones Industrial Average<sup>®</sup>. Existen más activos invertidos en productos vinculados a nuestros índices que en los productos basados en índices 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/es](http://www.spglobal.com/spdji/es).

### **PARA MÁS INFORMACIÓN:**

#### **S&P Dow Jones Indices**

[index\\_services@spglobal.com](mailto:index_services@spglobal.com)

---

<sup>1</sup> Esta medida no aplica a los S&P/BMV IPC ESG Tilted Indices ni al S&P/BMV IPC CompMX Trailing Income Equities ESG Tilted Index debido a que estos índices están sujetos a un calendario trimestral de reconstitución