

## Tratamiento de las Escisiones en los Índices S&P/BMV - Actualización de la Metodología

**CIUDAD DE MÉXICO, MARZO 26, 2024:** S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) anuncia un cambio en la metodología de los S&P/BMV Indices.

Para mantener la adecuada representatividad del mercado en los Índices S&P/BMV IPC y S&P/BMV INMEX, S&P DJI está modificando el tratamiento de las escisiones corporativas. Además, con el fin de brindar más tiempo a los participantes del mercado para implementar cambios en la composición de los índices que se enumeran en la siguiente tabla, S&P DJI está cambiando el plazo de notificación de eliminaciones a los mismos en caso de un evento de escisión.

La tabla a continuación describe los cambios en cuestión.

Metodología			
Cambio	Previo	Actualización	
<p>Escisiones corporativas</p> <p>S&amp;P/BMV IPC y S&amp;P/BMV INMEX</p>	<p>La compañía escindida permanece en el índice y es evaluada para considerar su continuidad como miembro del índice en la reconstitución subsecuente</p>	<p><b>S&amp;P/BMV IPC y S&amp;P/BMV INMEX.</b> Si un componente del índice se escinde o divide una parte de su negocio para crear una o más entidades nuevas, la (s) compañía (s) escindida (s) se agrega (n) al índice a precio “cero” al cierre del mercado del día anterior a la fecha Ex - date, sin ajuste al divisor.</p> <p>Para determinar la permanencia en el índice de alguna o de todas las corporaciones involucradas en la escisión, se ordenan de mayor a menor junto con los componentes vigentes del índice de acuerdo a su FMC a la fecha Ex – date del evento corporativo. El índice retiene a las emisoras más grandes del ranking para cumplir con la cuenta de componentes de la tabla a continuación.</p> <p>Existen tres posibles escenarios para retener / eliminar emisoras según la posición en el ranking por FMC ante un evento de escisión corporativa:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Todas las emisoras.</b> Se retienen todas las emisoras que se encuentren dentro del recuento de componentes del índice en cuestión y se evalúan de manera individual para considerar su continuidad dentro del índice en la reconstitución subsecuente, según lo definido por su fecha de referencia del rebalanceo.</li> <li>• <b>Una emisora.</b> La emisora en cuestión se mantiene dentro de la cuenta de componentes según su clasificación en el ranking. El resto de empresas involucradas en la escisión se eliminan después de al menos cinco días de</li> </ul>	

Metodología								
Cambio	Previo	Actualización						
		<p>negociación regular en bolsa, con un ajuste al divisor.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Ninguna emisora.</b> Si ninguna emisora se encuentra clasificada en alguna de las posiciones que delimita la cuenta de componentes del índice relevante, todas se eliminan después de al menos cinco días de negociación regular en bolsa, con un ajuste del divisor.</li> </ul> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Índice</th> <th>Cuenta de Componentes</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>S&amp;P/BMV IPC</td> <td>35</td> </tr> <tr> <td>S&amp;P/BMV INMEX</td> <td>18</td> </tr> </tbody> </table>	Índice	Cuenta de Componentes	S&P/BMV IPC	35	S&P/BMV INMEX	18
Índice	Cuenta de Componentes							
S&P/BMV IPC	35							
S&P/BMV INMEX	18							
<p>Plazo de notificación para las eliminaciones al índice en los casos de escisiones corporativas</p>	<p>Para el caso de los índices listados a continuación, la compañía escindida se agrega al índice a precio “cero” y se remueve del índice después del primer día de negociación regular en bolsa, considerando que la eliminación del índice se anuncia con al menos <b>dos</b> días de anticipación a la fecha de la exclusión:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• S&amp;P/BMV Bursa Óptimo</li> <li>• S&amp;P/BMV Rentable</li> <li>• S&amp;P/BMV IPC CompMx Rentable</li> <li>• S&amp;P/BMV IPC CompMx Rentable ESG Tilted</li> <li>• S&amp;P/BMV Ingenius</li> <li>• S&amp;P/BMV IPC de Calidad, Valor y Crecimiento</li> <li>• S&amp;P/BMV Índices Unifactoriales S&amp;P/BMV Índices Unifactoriales - Versiones Ponderadas</li> <li>• S&amp;P/BMV Total Mexico ESG</li> <li>• S&amp;P/BMV Formador de Mercado</li> <li>• S&amp;P/BMV China SX20</li> <li>• S&amp;P/BMV IPC ESG Tilted Indices</li> </ul>	<p>Para el caso de los índices listados a continuación, la compañía escindida se agrega al índice a precio “cero” y se remueve del índice después del primer día de negociación regular en bolsa, considerando que la eliminación del índice se anuncia con al menos <b>cinco</b> días de anticipación a la fecha de la exclusión:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• S&amp;P/BMV Bursa Óptimo</li> <li>• S&amp;P/BMV Rentable</li> <li>• S&amp;P/BMV IPC CompMx Rentable</li> <li>• S&amp;P/BMV IPC CompMx Rentable ESG Tilted</li> <li>• S&amp;P/BMV Ingenius</li> <li>• S&amp;P/BMV IPC de Calidad, Valor y Crecimiento</li> <li>• S&amp;P/BMV Índices Unifactoriales S&amp;P/BMV Índices Unifactoriales - Versiones Ponderadas</li> <li>• S&amp;P/BMV Total Mexico ESG</li> <li>• S&amp;P/BMV Formador de Mercado</li> <li>• S&amp;P/BMV China SX20</li> <li>• S&amp;P/BMV IPC ESG Tilted Indices</li> </ul>						

S&P DJI implementará los citados cambios antes de la apertura de mercado del **Lunes 6 de Mayo de 2024**.

Considere que la Metodología de los S&P/BMV Indices en el website de S&P DJI será modificada para reflejar el presente cambio.

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

#### ACERCA DE S&P DOW JONES INDICES

S&P Dow Jones Indices es proveedor de datos, investigación y conceptos acerca de índices, más grande a nivel mundial, así como hogar de indicadores financieros iconos de la industria, como los índices S&P 500® y el Dow Jones Industrial Average®. Más activos son invertidos en productos basados en nuestros índices que en ningún otro proveedor en el mundo. Desde que Charles Dow

#### ANUNCIO DEL ÍNDICE

inventó el primer índice en 1884, S&P DJI se ha convertido en la casa de alrededor de 1,000,000 de índices dentro del espectro de las distintas clases de activos que han definido la forma en que los inversionistas parametrizan y hacen negocios en el mercado.

S&P Dow Jones Indices es una división de S&P Global (NYSE: SPGI), que provee inteligencia financiera esencial a individuos, empresas y gobiernos para una óptima y segura toma de decisiones. Para más información, visite [www.spglobal.com/spdji](http://www.spglobal.com/spdji).

**PARA MAYOR INFORMACION:**

**S&P Dow Jones Indices**

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