

## Resultados de la consulta sobre los criterios de ponderación y rebalanceo de los índices S&P/BMV Total Mexico, S&P/BMV IPC CompMx, S&P/BMV IPC LargeCap, S&P/BMV IPC MidCap y S&P/BMV IPC SmallCap

CIUDAD DE MÉXICO, JULIO 2 DE 2024: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) ha iniciado una [consulta](#) dirigida a los participantes de mercado para conocer su opinión acerca de posibles cambios en los índices S&P/BMV Total Mexico, S&P/BMV IPC CompMx, así como en familia de índices S&P/BMV IPC LargeCap, MidCap y SmallCap.

Para mejorar la diversificación y al mismo tiempo estandarizar la metodología de todos los índices S&P/BMV, S&P DJI modificará los criterios de ponderación y rebalanceo de los citados índices.

La siguiente tabla resume los cambios para los índices S&P/BMV Total México y S&P/BMV IPC CompMx:

Cambio	Metodología	
	Anterior	Actualización
<b>Ponderación de los Componentes</b>	<p>El índice es ponderado en función de su Capitalización de Mercado Ajustado por Flotación o FMC, sujeto a las siguientes reglas:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>La ponderación máxima de cada serie accionaria es del 25%</li> <li>La suma de los pesos relativos de las cinco series accionarias con mayor peso en el índice no podrá exceder del 60%.</li> </ul>	<p>El índice es ponderado en función de su Capitalización de Mercado Ajustado por Flotación o FMC, sujeto a las siguientes reglas:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>La ponderación máxima de cada serie accionaria es del <b>15%</b></li> <li>La suma de los pesos relativos de las cinco series accionarias con mayor peso en el índice no podrá exceder del <b>45%</b>.</li> <li>El peso de cada serie accionaria se limita al <b>doble de la ponderación mínima por el FMC, y al peso por el criterio de liquidez</b> (según la métrica del MDVT de 6 meses) a la fecha de referencia del rebalanceo.</li> </ul>
<b>Rebalanceos/ Reponderaciones</b>	<p>El índice es reconstituido dos veces al año, con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de junio y diciembre.</p> <p>La fecha de referencia de cada rebalanceo es el último día hábil de <b>abril y octubre</b> respectivamente.</p> <p>Asimismo, el índice es reponderado fuera de la programación bianual de las reconstituciones, con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de <b>marzo y septiembre</b>.</p> <p>La cuenta de acciones del índice se calcula tomando los precios de cierre de los siete días hábiles previos a la fecha efectiva del rebalanceo.</p>	<p><b>Rebalanceo semestral.</b> Los índices son rebalanceados dos veces al año, con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de <b>marzo y septiembre</b>. La fecha de referencia de cada rebalanceo es el último día hábil de <b>enero y julio</b> respectivamente.</p> <p><b>Reponderaciones Trimestrales.</b> Los índices se reponderan trimestralmente fuera de la programación bianual de las reconstituciones, con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de <b>junio y diciembre</b>.</p> <p>La cuenta de acciones por componente del índice se calcula tomando los precios de cierre del miércoles previo al primer viernes del mes de rebalanceo (precios de referencia) y se asigna a la serie accionaria</p>

	correspondiente para alcanzar las ponderaciones determinadas en la fecha de referencia del rebalanceo.
--	--

La siguiente tabla resume los cambios propuestos para la familia de índices compuesta por los índices S&P/BMV IPC LargeCap, S&P/BMV IPC MidCap y S&P/BMV IPC SmallCap

Cambio	Metodología	
	Anterior	Actualización
<b>Ponderación de los Componentes</b>	<p>Cada índice adopta el esquema de Ponderación por Capitalización de Mercado Ajustada por Flotación (FMC), considerando las siguientes reglas:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>La ponderación máxima de cada serie accionaria es del <b>25%</b></li> <li>La suma de los pesos relativos de las cinco series accionarias con mayor peso en el índice no podrá exceder del <b>60%</b>.</li> <li>La ponderación máxima de un componente en el índice se determina como el cociente de su Mediana del Valor Diario de Transacciones (MDVT, por sus siglas en inglés) en 6 meses dividido sobre la suma de los MDVT en 6 meses de todos los componentes del índice, multiplicado por dos. Si el peso de acuerdo con el "FMC" de una emisora excede la ponderación máxima definida con el cálculo previamente descrito, la acción en cuestión sujetaría su peso a la ponderación máxima que le corresponda; en tanto que el excedente del peso será repartido proporcionalmente entre el resto de las acciones que aún no hayan alcanzado el tope a su ponderación.</li> </ul>	<p>Cada índice adopta el esquema de Ponderación por Capitalización de Mercado Ajustada por Flotación (FMC), considerando el número de componentes para la aplicación de las siguientes reglas:</p> <p><i>Cuando el número de componentes en el índice <math>\geq 17</math> (criterio estándar):</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>La ponderación máxima de cada serie accionaria es del <b>15%</b></li> <li>La suma de los pesos relativos de las cinco series accionarias con mayor peso en el índice no podrá exceder del <b>45%</b>.</li> </ul> <p><i>Cuando el número de componentes en el índice <math>\leq 15</math> (flexibilización del criterio):</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>La ponderación máxima de cada serie accionaria es del <b>15%</b></li> <li>La suma de los pesos relativos de las cinco series accionarias con mayor peso en el índice no podrá exceder del <b>60%</b>.</li> </ul> <p>Si el número de componentes en el índice es de 16, se extiende la aplicación de la regla usada durante la reconstitución / rebalanceo anterior.</p>
<b>Rebalanceos/ Reponderaciones</b>	<p>Cada uno de los índices es reconstituido dos veces al año, con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de <b>junio y diciembre</b>.</p> <p>La fecha de referencia de cada reconstitución es el último día hábil de <b>abril y octubre</b> respectivamente.</p> <p>La cuenta de acciones de cada índice se calcula tomando los precios de cierre de los siete días hábiles previos a la fecha efectiva del rebalanceo.</p>	<p><b>Rebalanceo semestral.</b> Los índices son rebalanceados dos veces al año, con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de <b>marzo y septiembre</b>. La fecha de referencia de cada rebalanceo es el último día hábil de <b>enero y julio</b> respectivamente.</p> <p><b>Reponderaciones Trimestrales.</b> Los índices se reponderan trimestralmente fuera de la programación bianual de las reconstituciones, con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de <b>junio y diciembre</b>.</p> <p>La cuenta de acciones por componente del índice se calcula tomando los precios de cierre del miércoles previo al primer viernes del mes de rebalanceo (precios de referencia) y se asigna a la serie accionaria correspondiente para alcanzar las ponderaciones determinadas en la fecha de referencia del rebalanceo.</p>

## CALENDARIO DE IMPLEMENTACIÓN

S&P DJI implementará los cambios previamente descritos antes de la apertura de mercado del **Lunes 23 de Septiembre de 2024**, conjuntamente con el rebalanceo semestral de Septiembre. El impacto de los cambios en cuestión será visible para nuestros clientes en los archivos proforma a partir del **Viernes 6 de Septiembre de 2024**

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 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)