

Resultados de la Consulta sobre los Criterios de Selección del S&P/BMV China SX20 Index

CIUDAD DE MÉXICO, FEBRERO 27, 2023: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) ha lanzado una [consulta](#) dirigida a los participantes de mercado para conocer su opinión acerca de posibles cambios en el S&P/BMV China SX20 Index.

Con la intención de implementar un criterio de selección más efectivo según la liquidez, así como alinear la metodología en cuestión con el resto de las metodologías de los índices con la marca de S&P DJI, el Factor por Bursatilidad será reemplazado por la Mediana del Valor Diario de Transacciones (“MDVT”) de seis meses. Las normas de flexibilidad o “buffer rules” propuestas en la consulta que antecede a este anuncio no serán implementadas. Las tablas a continuación resumen los cambios en los Criterios de Selección:

Criterio de Liquidez	
Anterior	Factor por Bursatilidad. Las series accionarias del Universo de Selección son ordenadas de manera descendente con base en su calificación promedio de acuerdo con el Índice de Bursatilidad Global ¹ durante los seis meses calendario anteriores a la fecha de referencia del rebalanceo.
Actualización	Liquidez. Las series accionarias del Universo de Selección son ordenadas de manera descendente de acuerdo con la Mediana local del Valor Diario de Transacciones (MDVT) de los seis meses de cotización en los EE.UU. ² previos a la fecha de referencia del rebalanceo del índice

Constituent Selection	
Anterior	<ul style="list-style-type: none"> Una vez que los componentes del índice han sido ordenados de manera descendente según su Factor por Bursatilidad y su Valor por Capitalización de Mercado Flotante calculado con el Precio Promedio Ponderado por Volumen o VWAP FMC, se determina una calificación conjunta según el lugar que ocupen de manera consecutiva en el paso anterior. La calificación conjunta de cada serie accionaria se determina sumando las posiciones de ambos rankings. Las 20 series accionarias con la menor calificación conjunta son seleccionadas para formar parte del índice. En caso de que dos o más series accionarias obtengan la misma calificación conjunta, la acción con el VWAP FMC más alto es seleccionada.
Actualización	Sin cambios en la metodología.

Asimismo, S&P DJI modificará el tratamiento de las series accionarias múltiples para implementar el reemplazo del Factor de Bursatilidad por el MDVT de seis meses en la conformación del Universo de Selección:

Cambio	Metodología	
	Anterior	Actualización
Universo de Selección	Series Accionarias Múltiples. Si una compañía cuenta con más de una serie accionaria, aquella con la mayor operatividad se acuerdo con el Índice de Bursatilidad Global será elegida.	Series Accionarias Múltiples. Si una compañía cuenta con más de una serie accionaria, aquella con la Mediana local del Valor Diario de Transacciones (MDVT) más alta de los seis meses de cotización en los EE.UU. previos a la fecha de referencia del rebalanceo del índice será elegida.

¹ Los Puntajes de Bursatilidad Global se calculan con las acciones listadas en la BMV. Para obtener más información sobre los Puntajes de Bursatilidad, consulte la Metodología del Índice de Bursatilidad de la BMV disponible en www.bmv.com.mx/docspub/INDICES/CTEN_INOT/BMV_MARKETABILITY_INDEX_METHODOLOGY.PDF

² La Mediana local del Valor Diario de Transacciones (MDVT) mensual se calcula con las acciones cotizadas en los EE.UU. es decir, tomando la liquidez global.

CALENDARIO DE IMPLEMENTACIÓN

S&P DJI implementará los cambios previamente descritos en la metodología conjuntamente con el próximo rebalanceo del índice, que será efectivo antes de la apertura de mercado del **Lunes 20 de Marzo de 2023**. Los cambios descritos en este documento serán visibles para nuestros clientes en los archivos proforma a partir del **Viernes 10 de Marzo de 2023**.

Para más información acerca de S&P Dow Jones Indices, visite 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.

PARA MAYOR INFORMACION:

S&P Dow Jones Indices
index_services@spglobal.com