

S&P Dow Jones Indices anuncia actualizaciones en las directrices por capitalización de mercado y los resultados de la consulta acerca de los criterios por capitalización de mercado y liquidez para formar parte del S&P Composite 1500

NEW YORK, ENERO 4, 2023: S&P Dow Jones Indices ("S&P DJI") ha actualizado los criterios por capitalización de mercado para formar parte de los índices miembro del S&P Composite 1500. Siendo efectivo el **4 de Enero de 2023**, los rangos por tamaño serán actualizados como se muestra a continuación:

Criterios de Elegibilidad por Capitalización de Mercado (Anteriores)	Criterios de Elegibilidad por Capitalización de Mercado (Nuevos)
Valor por Capitalización de Mercado No Ajustado para la empresa en cuestión: • US\$ 14.6 mil millones o más para el S&P 500 • De US\$ 3.7 mil millones a US\$ 14.6 mil millones para el S&P MidCap 400 • De US\$ 850 millones a US\$ 3.7 mil millones para el S&P SmallCap 600	Valor por Capitalización de Mercado No Ajustado para la empresa en cuestión: • US\$ 12.7 mil millones o más para el S&P 500 • De US\$ 4.6 mil millones a US\$ 12.7 mil millones para el S&P MidCap 400 • De US\$ 750 millones a US\$ 4.6 mil millones para el S&P SmallCap 600

Con base en los comentarios recibidos en la [Consulta](#) sobre los Criterios por Capitalización de Mercado y Liquidez para formar parte del S&P Composite 1500, el Comité del Índice ha decidido adoptar las pautas propuestas a los criterios por capitalización de mercado y liquidez ajustada por flotación ("FALR"). Estos rangos se revisarán al comienzo de cada trimestre del año calendario, y se actualizarán según sea necesario para garantizar que reflejen las condiciones actuales del mercado y se expresarán en dólares americanos. Los umbrales mínimos por capitalización de mercado están diseñadas para capturar el promedio de la capitalización de mercado total acumulada de tres meses de las corporaciones que forman parte del S&P Total Market Index ("TMI"), clasificando estos valores acumulados en los siguientes percentiles:

- S&P 500 – 85th percentil
- S&P MidCap 400 index – 85th-93rd percentil
- S&P SmallCap 600 index – 93rd-99th percentil

Durante la revisión trimestral, si los nuevos rangos de capitalización de mercado para cualquiera de los índices del Composite 1500 se desvían en un 10 % o más del rango actual, el Comité del Índice considerará una actualización del rango de capitalización de mercado para todos los índices subyacentes. Las actualizaciones, si son necesarias, se anuncian oficialmente con efecto inmediato.

Las empresas que superan los criterios de capitalización de mercado total a nivel individual también deben tener una capitalización de mercado ajustada por flotación (FMC) a nivel de la acción per se que sea al menos el 50 % del umbral de capitalización de mercado mínimo total a nivel de emisora en el índice respectivo.

Estos ajustes a las pautas de capitalización de mercado pueden resultar en una rotación adicional en los índices del S&P Composite 1500, ya que los índices reflejan gradualmente los cambios en los rangos de las pautas de capitalización de mercado para los índices subyacentes a lo largo del tiempo.

El criterio de elegibilidad según el FALR será ajustado de 1.00 a 0.75, reflejando el aumento en la liquidez en el mercado resultante de las adiciones anunciadas al Composite 1500.

Como aclaración, los criterios de elegibilidad por liquidez en la metodología de los U.S. Indices están siendo actualizados para mostrar que el cálculo del FALR toma únicamente el volumen negociado en los EE. UU. Asimismo, se anualizará el volumen operado en los EE. UU. de las empresas públicas que se consideren domiciliadas en los EE. UU. a la fecha de evaluación cuando no tengan 365 días calendario de historial de cotización en alguna bolsa de los EE. UU. Se elimina la frase "en todos los lugares (incluidos los valores históricos)".

Criterio de Elegibilidad según el FALR (Anterior)	Criterio de Elegibilidad según el FALR (Actualización)
El ratio de Liquidez Ajustado por Flotación ("FALR") debe ser superior o igual a 1.0 en el momento en que la acción es agregada al S&P Composite 1500.	El ratio de Liquidez Ajustado por Flotación ("FALR") debe ser superior o igual a 0.75 en el momento en que la acción es agregada al S&P Composite 1500.

Como recordatorio, el criterio de elegibilidad por capitalización de mercado se aplica para evaluar adiciones al índice, no para valorar la continuidad de un miembro en la composición del indicador. En consecuencia, un componente que aparentemente infrinja los criterios para adiciones al índice correspondiente no será eliminado a menos que el contexto vigente justifique un cambio en el índice.

En el Apéndice A de la Metodología de los US Indices, se documenta el historial de los rangos de capitalización de mercado desde 2007. Tenga en cuenta que la Metodología los US Indices publicada en el sitio Web de S&P DJI está siendo actualizada para reflejar este cambio. Para mayor información, visite nuestro sitio web www.spglobal.com/spdji

Para mayor información acerca d S&P Dow Jones Indices, visite nuestro sitio web www.spglobal.com/spdji

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® 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.spdji.com.

PARA MAYOR INFORMACIÓN:

S&P Dow Jones Indices
index_services@spglobal.com

Relación con los Medios
spdji.comms@spglobal.com