

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

27 de febrero, 2017

Acuerdo de transición de los índices de renta variable entre S&P Dow Jones Indices (S&P DJI) y la Bolsa Mexicana de Valores (BMV)

En mayo de 2015, la Bolsa Mexicana de Valores (BMV) y S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) firmaron un acuerdo para el licenciamiento, distribución y administración de índices. La colaboración entre BMV y S&P DJI, uno de los líderes mundiales en la industria de índices, garantiza que la familia de índices actuales de la BMV se adapte a los estándares internacionales y que adquiera visibilidad en los mercados globales mediante los amplios canales de distribución con los que cuenta S&P DJI. El acuerdo también incluye la creación de nuevos índices para el mercado mexicano. Los índices actuales de la BMV y los nuevos índices tendrán la marca “S&P/BMV” (de ahora en adelante, los “Índices”).

En virtud de este acuerdo, S&P DJI asumirá las tareas de cálculo, producción, mantenimiento, otorgamiento de licencias y distribución de los Índices el día lunes 5 de junio de 2017. La BMV continuará otorgando licencias y distribuyendo datos de los Índices en tiempo real mediante los formatos “U” y “MA” dentro del servicio de fuente de datos en tiempo real.

CALENDARIO DE TRANSICIÓN

- | | |
|--------------------------|---|
| 27 de marzo, 2017 | Inicio del periodo paralelo en que los clientes podrán comenzar a recibir archivos en el formato UFF 2.0 (Universal File Format) de S&P DJI. Los archivos y cálculos de la BMV seguirán siendo los oficiales hasta el 2 de junio de 2017. |
| 2 de junio, 2017 | Fin del periodo de paralelo. |
| 5 de junio, 2017 | Fecha oficial de inicio, que incluye las siguientes actividades: <ul style="list-style-type: none">• Cambio de nombre de los Índices a S&P/BMV;• Publicación de las metodologías revisadas y con la nueva marca en el sitio web de S&P DJI, tanto en inglés (www.spdji.com) como en español (www.espanol.spdji.com), y en el sitio web de la BMV (www.bmv.com.mx);• S&P DJI se convertirá en el responsable oficial del cálculo de los índices incluidos en el Anexo 1;• Inicio de uso de los archivos de S&P DJI (entrega sólo mediante SFTP);• Descontinuación de los archivos de cierre de día de negociación de la BMV; y• Ajuste de los niveles de los Índices de acuerdo a los valores oficiales de la BMV del 2 de junio de 2017, con el fin de garantizar la continuidad en los datos de los índices durante el proceso de transición. |

CAMBIOS EN LOS ARCHIVOS DE DATOS DE ÍNDICES Y SU DISTRIBUCIÓN

*****IMPORTANTE: Los clientes deberán adoptar las medidas necesarias para evitar la interrupción en la entrega de datos.*****

Si usted no es la persona indicada para contactar durante el proceso de transición, por favor reenvíe este documento a la persona adecuada dentro de su empresa.

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

ARCHIVOS DE CIERRE DE DÍA DE NEGOCIACIÓN

- S&P DJI pondrá a disposición los datos de los Índices, a todos los suscriptores y proveedores de índices de la BMV, en el formato que reemplazará a los archivos actuales. Estos nuevos archivos tendrán el formato UFF 2.0 y serán proporcionados para efectos de la realización de pruebas durante el periodo de paralelo, que comienza el día lunes 27 de marzo de 2017.
- Todos los datos de los Índices estarán disponibles a partir del 5 de junio de 2017 únicamente en el formato UFF 2.0 y a través de la plataforma EDX de S&P DJI .
- A partir del 5 de junio de 2017, los datos de cierre de día de negociación dejarán de estar disponibles en el formato de archivos de la BMV.
- Los nuevos archivos en el formato UFF 2.0 permanecerán en la bandeja de entrada de los suscriptores en la plataforma EDX por un periodo de 7 días naturales.
- Los nombres de los archivos donde se incluye información de los índices también serán modificados durante el proceso de transición. Un archivo que contiene los nombres antiguos y nuevos de los archivos se encuentra disponible en la dirección <http://spindices.com/client-services/current-transitions>.

ARCHIVOS DE EVENTOS CORPORATIVOS

- Los nuevos archivos de eventos corporativos en el formato *.SDE serán entregados luego del cierre de las negociaciones de cada día hábil.
- El envío de los archivos mediante correo electrónico se cancelará después de la finalización del periodo paralelo y en su lugar se utilizarán los archivos *.SDE, que estarán disponibles solamente en la plataforma EDX.
- Los archivos *.SDE incluirán columnas que actualmente no se encuentran en los archivos de eventos corporativos de la BMV. Una gama más amplia de eventos se encontrará disponibles en los archivos *.SDE.
- Cada índice tendrá su propio archivo *.SDE, que incluirá eventos corporativos que le afecten específicamente.
- Los archivos en el formato *.SDE notificarán de manera anticipada cualquier evento que tenga validez a partir de la fecha actual más un periodo de 20 días.

ANUNCIOS DE REBALANCEO

- Los anuncios de rebalanceo de la BMV, que son enviados mediante correo electrónico, tendrán una transición hacia los archivos proforma UFF 2.0: *_PRO.SDC.
- El envío de correos electrónicos de los anuncios de rebalanceo de la BMV se suspenderá después de la finalización del periodo paralelo.
- Los archivos *_PRO.SDC serán distribuidos cada vez que ocurra el rebalanceo de un índice con cinco días hábiles de anticipación con respecto a cada rebalanceo y de forma diaria. Este periodo se extenderá a 10 días en el caso de rebalanceos del IPC.
- Un resumen de los cambios derivados del rebalanceo será también incluido en el archivo diario de eventos corporativos (formato UFF 2.0) cada vez que ocurra el rebalanceo de un índice.
- Para efectos de la reponderación de Índices, a partir del 5 de junio de 2017, S&P DJI utilizará los datos al cierre de las negociaciones de 2 días hábiles anteriores con respecto a la fecha de anuncio de rebalanceo para precios y tipos de cambio, a fin de establecer la nuevas participaciones en el índice, las cuales no tendrán cambios hasta la fecha efectiva de rebalanceo.

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

METODOLOGÍA

- Un nuevo comité integrado por S&P y la BMV ha sido creado para administrar la familia de índices S&P/BMV.
- A partir del 5 de junio de 2017, las metodologías con la nueva marca estarán disponibles en el sitio web de S&P DJI, tanto en español como en inglés, en las direcciones www.spdji.com y www.espanol.spdji.com; así como en el sitio web de la BMV, en www.bmv.com.mx. Para conocer las metodologías existentes en el sitio web de la BMV, visite la dirección <https://www.bmv.com.mx/en/indices/main/>.
- Cualquier cambio metodológico en el cálculo o mantenimiento de los índices, que sea resultado de este proceso de transición, será anunciado con antelación antes del 5 de junio de 2017.

Observación: Los archivos paralelos no estarán disponibles en la plataforma EDX hasta el inicio de la transición el día 27 de marzo de 2017.

Para tener acceso a los nuevos archivos y garantizar el acceso ininterrumpido a los datos, por favor entre contacto con S&P DJI, en la dirección index_services@spglobal.com, o con Manuel A. González, escribiendo al correo manuel.gonzalez2@spglobal.com; antes del 27 de marzo de 2017 (la fecha de inicio del periodo de paralelo).

Para más información, visite el Centro de Información para Clientes de S&P DJI en la dirección <http://spindices.com/client-services/current-transitions>, donde podrá encontrar un documento de especificaciones sobre los archivos UFF 2.0, archivos de muestra UFF 2.0, un documento de Preguntas frecuentes y mayores detalles sobre la relación entre los archivos de la BMV y los nuevos archivos de S&P DJI en el formato UFF 2.0.

Le mantendremos al tanto de lo que ocurra en este proceso de transición. Para más consultas, por favor entre contacto con nuestro equipo de atención al cliente, escribiendo a la dirección Index_Services@spglobal.com, o con Manuel A. González en manuel.gonzalez2@spglobal.com.

Saludos cordiales,

S&P DOW JONES INDICES

Pekín +86 10 6569 2905 | Dubái +9714 3717131 | Hong Kong +852 2532 8000 | Londres +44 20 7176 8888 | Nueva York +1 609 520 4040 | Sídney +61 2 9255 9802 | Tokio +813 4550 8564

index_services@spglobal.com

www.spdji.com | www.djindexes.com | www.spglobal.com

Acerca de S&P Dow Jones Indices

S&P Dow Jones Indices LLC, una filial de S&P Global, es el mayor centro mundial de ideas, datos e investigación con base en índices. Es, además, la cuna de emblemáticos indicadores del mercado financiero, como el S&P 500® y el Dow Jones Industrial Average®. S&P Dow Jones Indices LLC posee más de 115 años de experiencia en la creación de soluciones innovadoras y transparentes para pequeños y grandes inversionistas. Existen más activos invertidos en productos vinculados a nuestros índices que en los productos de cualquier otro proveedor en el mundo. S&P Dow Jones Indices LLC, que cuenta con más de un millón de índices que abarcan una amplia gama de clases de activos en todo el mundo, define la manera en que los inversionistas miden los mercados y operan en ellos. Para saber más sobre nuestra compañía, por favor visite www.spdji.com.

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

S&P® es una marca comercial registrada de Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"). Dow Jones® es una marca comercial registrada de Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"). El uso de estas marcas comerciales se ha otorgado bajo licencia a S&P Dow Jones Indices LLC. No es posible invertir directamente en un índice. S&P Dow Jones Indices LLC, Dow Jones, S&P y sus respectivas filiales (en conjunto "S&P DJI") no patrocinan, avalan, venden o promueven ningún fondo de inversión u otros instrumentos de inversión ofrecidos por terceros y que busquen proporcionar un rendimiento sobre la inversión basado en el desempeño de cualquier índice. Este documento no constituye una oferta de servicios en aquellas jurisdicciones en que S&P DJI no cuente con las autorizaciones necesarias. S&P DJI recibe compensación relacionada con el otorgamiento de licencias de sus índices a terceros.

Para más información:

S&P Dow Jones Indices

Soogyung Cho Jordan
Global Head of Communications
S&P Dow Jones Indices
(+1) 212 438 2297
soogyung.jordan@spglobal.com

S&P Global

Miriam Hespanhol
Senior Communications Manager
S&P Global
(+1) 212 438 1406
miriam.hespanhol@spglobal.com

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

ANEXO 1: LISTA DE ÍNDICES

NOMBRE ACTUAL DEL ÍNDICE	NUEVO NOMBRE S&P/BMV	Código	Bloomberg	Reuters
IPC (Índice de Precios y Cotizaciones)	S&P/BMV Índice De Precios Y Cotizaciones	ME0000	MEXBOL	.MXX
IRT (Índice de Rendimiento Total)	S&P/BMV Índice De Rendimiento Total	RT0000	IRT	
IPC CompMx (Índice Compuesto del Mercado Mexicano)	S&P/BMV IPC CompMx	600000	IPCCOMP	.MXXCP
IRT CompMx (Índice Compuesto del Mercado Mexicano)	S&P/BMV IRT CompMx	R60000	IRTCOMP	
IPC LargeCap (Índice de Empresas de Alta Capitalización)	S&P/BMV IPC LargeCap	CP0000	IPCLARGE	.MXXLG
IRT LargeCap (Índice de Empresas de Alta Capitalización)	S&P/BMV IRT LargeCap	RP0000	IRTLARGE	
IPC MidCap (Índice de Empresas de Media Capitalización)	S&P/BMV IPC MidCap	CG0000	IPCMID	.MXXMI
IRT MidCap (Índice de Empresas de Media Capitalización)	S&P/BMV IRT MidCap	RG0000	IRTMID	
IPC SmallCap (Índice de Empresas de Pequeña Capitalización)	S&P/BMV IPC SmallCap	CM0000	IPCSMALL	.MXXSM
IRT SmallCap (Índice de Empresas de Pequeña Capitalización)	S&P/BMV IRT SmallCap	RM0000	IRTSMALL	
BMV Fibras	S&P/BMV FIBRAS	FB0000	FBMEX	
BMV Fibras RT	S&P/BMV FIBRAS RT	FR0000		
IPC Sustentable	S&P/BMV IPC Sustentable	GI0000	MEXGI	
IPC Sustentable RT	S&P/BMV IPC Sustentable RT	GT0000		
HABITA (índice de Vivienda)	S&P/BMV HABITA	IH0000	HABITA	
HABITA RT (índice de Vivienda)	S&P/BMV HABITA RT	HT0000		
INMEX (Índice México)	S&P/BMV Índice México	IM0000	INMEX	.INMX
INMEX RT (Índice México RT)	S&P/BMV Índice México De Rendimiento Total	IT0000		
Bursa Óptimo	S&P/BMV Bursa Óptimo	VD0000		
Bursa Óptimo RT	S&P/BMV Bursa Óptimo RT	VT0000		
BMV-Extractiva	S&P/BMV Extractiva (Minería y Agricultura)	AS1000		
BMV-Extractiva RT	S&P/BMV Extractiva (Minería y Agricultura) RT	AT1000	MEXAT1	
BMV-Transforma	S&P/BMV Transforma (Industria manufacturera, electricidad, gas y agua)	AS2000		
BMV-Transforma RT	S&P/BMV Transforma (Industria manufacturera, electricidad, gas y agua) RT	AT2000	MEXAT2	
BMV-Construye	S&P/BMV Construye (Construcción)	AS3000		
BMV-Construye RT	S&P/BMV Construye (Construcción) RT	AT3000	MEXAT3	
BMV-Comercio	S&P/BMV Comercio (Casas Comerciales y Distribuidores)	AS4000		
BMV-Comercio RT	S&P/BMV Comercio (Casas Comerciales y Distribuidores) RT	AT4000	MEXAT4	
BMV-Enlace	S&P/BMV Enlace (Infraestructura y Transportes)	AS5000		
BMV-Enlace RT	S&P/BMV Enlace (Infraestructura y Transportes) RT	AT5000		
BMV-Servicios	S&P/BMV Servicios (Servicios Financieros)	AS6000		
BMV-Servicios RT	S&P/BMV Servicios (Servicios Financieros) RT	AT6000	MEXAT6	
BMV-Servicios Comerciales	S&P/BMV Servicios Comerciales (Comercio y Prestación de Servicios)	AS7000		
BMV-Servicios Comerciales RT	S&P/BMV Servicios Comerciales (Comercio y Prestación de Servicios) RT	AT7000		
Índice BMV Rentable	S&P/BMV Rentable	DT0000		

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

ANEXO 1: LISTA DE ÍNDICES (continuación)

NOMBRE ACTUAL DEL ÍNDICE	NUEVO NOMBRE S&P/BMV	Código	Bloomberg	Reuters
BMV-Materiales	S&P/BMV Sector Selectivo Materiales	SN1000		
BMV-Materiales RT	S&P/BMV Sector Selectivo Materiales RT	ST1000	MEXST1	
BMV-Industrial	S&P/BMV Sector Selectivo Industrial	SN2000		
BMV-Industrial RT	S&P/BMV Sector Selectivo Industrial RT	ST2000	MEXST2	
BMV-Consumo	S&P/BMV Sector Selectivo Consumo Frecuente	SN3000		
BMV-Consumo RT	S&P/BMV Sector Selectivo Consumo Frecuente RT	ST3000	MEXST3	
BMV-Financiero	S&P/BMV Sector Selectivo Financiero	SN5000		
BMV-Financiero RT	S&P/BMV Sector Selectivo Financiero RT	ST5000		
IMC 30 (Índice de Mediana Capitalización)	S&P/BMV Índice De Mediana Capitalización	MC0000	IMC30	.IMC30
MATERIALES	S&P/BMV Sector Materiales	SE2000		
INDUSTRIAL	S&P/BMV Sector Industrial	SE3000		
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO	S&P/BMV Sector Servicio de Consumo no Básico	SE4000		
PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE	S&P/BMV Sector Productos de Consumo Frecuente	SE5000		
SALUD	S&P/BMV Sector Salud	SE6000		
SERVICIOS FINANCIEROS	S&P/BMV Sector Servicios Financieros	SE7000		
SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES	S&P/BMV Sector Servicios de Telecomunicaciones	SE9000		
Índice México-Brasil (IMeBz)	S&P/BMV México-Brasil	MB0000		.IMEBZ
IMeBz RT	S&P/BMV México-Brasil RT	MT0000	IMEBZRT	
China SX20	S&P/BMV China SX20	CX0000	CHINASX2	
China SX20 RT	S&P/BMV China SX20 RT	CT0000	CT20RT	
BMV-Brasil 15	S&P/BMV Brasil 15	BB0000	BMBRATM	
BMV-Brasil 15 RT	S&P/BMV Brasil 15 RT	BT0000	BMBBRART	
BMV MXP-USD	S&P/BMV MXN-USD	MU0000	MUMEX	
BMV USD-MXP	S&P/BMV USD-MXN	UM0000		
Índice Diario Doble de la BMV	S&P/BMV Diario Doble	DD0000		
Índice Diario Inverso de la BMV	S&P/BMV Diario Inverso	DI0000		