

Resultados de la Consulta sobre los índices S&P/BMV IPC CompMx, LargeCap, MidCap y SmallCap

CIUDAD DE MÉXICO, MAYO 21, 2018: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) ha iniciado una consulta dirigida a miembros de la comunidad inversionista sobre cambios potenciales en los índices S&P/BMV IPC CompMx y sus sub-índices. Con la intención de mejorar la liquidez de dichos índices, S&P DJI implementará los siguientes cambios a la metodología:

Metodología		
Cambio	Anterior	Vigente
<p>Criterios de Liquidez:</p> <p>S&P/BMV IPC CompMx</p>	<ul style="list-style-type: none"> Las series accionarias deben contar con un Factor de la Mediana del Importe Operado Mensual (MTVR, por sus siglas en inglés) de al menos 1% para los tres y doce meses calendario previos a la fecha de referencia de la reconstitución del índice. Las series con un MTVR menor al 1% pero superior a 0.5% para los tres y doce meses previos a la fecha de cambio de componentes, deberán contar con un Promedio del Valor Diario de Transacciones (ADVT, por sus siglas en inglés) de al menos 10 millones de Pesos Mexicanos durante los tres meses previos a la fecha de referencia de la reconstitución del índice. Los componentes vigentes del índice continuarán siendo elegibles si cuentan con un MTVR de al menos 0.5% durante los tres y doce meses previos a la fecha de referencia de reconstitución del índice. 	<ul style="list-style-type: none"> Las series accionarias deben contar con un Factor de la Mediana del Importe Operado Mensual (MTVR, por sus siglas en inglés) de al menos 1% para los tres y doce meses calendario previos a la fecha de referencia de la reconstitución del índice y una Mediana del Valor Diario de Transacciones (MDVT, por sus siglas en inglés) de al menos 4 millones de Pesos Mexicanos durante los tres meses previos a la fecha de referencia de la reconstitución del índice. Los componentes vigentes del índice continuarán siendo elegibles si cuentan con un MTVR de al menos 0.5% durante los tres y doce meses calendario previos a la fecha de referencia de reconstitución del índice y un MDVT de al menos 2 millones de Pesos Mexicanos durante los tres meses previos a la fecha de referencia de la reconstitución del índice.
<p>Selección de Componentes:</p> <p>S&P/BMV IPC LargeCap, MidCap y SmallCap</p>	<p>El tamaño de cada segmento está basado en la Capitalización de Mercado Total acumulada dentro del S&P/BMV IPC CompMx. Las compañías son ordenadas por su capitalización de mercado total, y ésta es acumulada hasta alcanzar el porcentaje del 75%; las compañías clasificadas hasta ese nivel conforman el segmento definido como LargeCap, el siguiente 20% como MidCap y el 5% restante como SmallCap.</p>	<p>El tamaño de cada segmento está basado en la Capitalización de Mercado Total acumulada dentro del S&P/BMV IPC CompMx. Las compañías son ordenadas de acuerdo a su Capitalización de Mercado Total, después la Capitalización de Mercado Ajustada por Flotación (FMC, por sus siglas en inglés) de cada serie accionaria será acumulada hasta alcanzar el porcentaje del 75%; las compañías clasificadas hasta ese nivel conformarán el segmento definido como LargeCap, el siguiente 20% como MidCap y el 5% restante como SmallCap.</p>

Metodología		
Cambio	Anterior	Vigente
Ponderación de los Componentes: S&P/BMV IPC LargeCap, MidCap y SmallCap	Cada índice se pondera en función de su valor por capitalización de mercado ajustado por flotación de acuerdo a las siguientes reglas: <ul style="list-style-type: none"> Ninguna serie accionaria puede tener una ponderación superior al 25% en el índice. La ponderación acumulada de las cinco series accionarias más grandes no puede exceder el 60% en el índice. Se aplicará una Canasta de Liquidez para cada uno de los tres segmentos por capitalización de mercado, usando un portafolio de 200 millones de Pesos Mexicanos para ser negociado en un día al 100% del valor de la Mediana del Valor Diario de Transacciones (MDVT, por sus siglas en inglés) en un periodo de seis meses. El Comité de Índices se reserva el derecho de modificar el tamaño del portafolio si las condiciones de mercado o algún otro factor así lo requieren. 	Cada índice se pondera en función de su valor por capitalización de mercado ajustado por flotación de acuerdo a las siguientes reglas: <ul style="list-style-type: none"> Ninguna serie accionaria puede tener una ponderación superior al 25% en el índice. La ponderación acumulada de las cinco series accionarias más grandes no puede exceder el 60% en el índice. 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 al "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.

Estos cambios se harán efectivos antes de la apertura de mercado del Lunes 18 de Junio de 2018, conjuntamente con el siguiente cambio de muestra semestral.

Tenga en cuenta que la metodología del índice en el sitio Web de S&P DJI (www.spdji.com) está siendo actualizada para reflejar estos cambios.

Para mayor información acerca de S&P DJI, visite nuestro sitio Web www.spdji.com.

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 íconos 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&PDJI 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.spdji.com.

PARA MAYOR INFORMACION:

S&P Dow Jones Indices
index_services@spglobal.com

ANUNCIO DEL ÍNDICE