

Resultados de la Consulta lanzada por S&P Dow Jones Indices sobre la Orden Ejecutiva de Prohibición de Negociación de Acciones de ciertas Emisoras Chinas

NEW YORK, DICIEMBRE 9, 2020: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) dirigió una consulta a la comunidad inversionista sobre el impacto de la Orden Ejecutiva firmada por el Presidente de los Estados Unidos de América el Jueves 12 de Noviembre de 2020. La citada orden prohíbe a inversionistas estadounidenses operar ciertos valores Chinos.

Se prevé que la orden entre en vigor el Lunes 11 de Enero de 2021 pudiendo afectar la capacidad de los participantes de mercado para replicar los índices de S&P DJI tanto de renta fija como de renta variable que contengan valores impactados por la orden. Consulte a continuación los valores e índices afectados, así como el plan de acción de S&P DJI para el manejo de la Orden Ejecutiva respecto a cada clase de activo.

Índices de Renta Variable

A partir del Lunes 21 de Diciembre de 2020¹ y de conformidad con la sección de Sanciones de la Metodología de las Políticas y Prácticas de los Índices de Renta Variable de S&P Dow Jones Indices, los valores de la tabla a continuación serán considerados como no elegibles para formar parte de los índices de renta variable de S&P DJI.

| Compañía | Tipo de valor | Ticker | Onshore RIC | Onshore SEDOL | Offshore RIC | Offshore SEDOL |
|--|---------------|--------|-------------|---------------|--------------|----------------|
| CRRC Corp. | A-Share | 601766 | 601766.SS | B3CPT84 | 601766.SH | BP3R358 |
| | H-Share | 1766 | -- | -- | 1766.HK | B2R2ZC9 |
| China Communications Construction Company (CCCC) | A-Share | 601800 | 601800.SS | B6Y7DS7 | 601800.SH | BP3R3C5 |
| | H-Share | 1800 | -- | -- | 1800.HK | B1JKTQ6 |
| | ADR | CCCGY | -- | -- | CCCGY.PK | B3KWPZ6 |
| China National Chemical Engineering Group Co. (CNCEC) | A-Share | 601117 | 601117.SS | B58R0Z2 | 601117.SH | BP3R4J9 |
| China Nuclear Engineering & Construction Corporation (CNECC) | A-Share | 601611 | 601611.SS | BYY7YM4 | 601611.SH | BYV1VD9 |
| China Spacesat Co., Ltd. | A-Share | 600118 | 600118.SS | 6018858 | 600118.SH | BP3R5Y1 |
| China State Construction International Holdings Ltd. | H-Share | 3311 | -- | -- | 3311.HK | B0BM5T8 |
| | ADR | CCOBY | -- | -- | CCOBY.PK | B3Y9326 |
| China Railway Construction Corporation (CRCC) | A-Share | 601186 | 601186.SS | B2PPPG4 | 601186.SH | BP3R381 |
| | H-Share | 1186 | -- | -- | 1186.HK | B2PFVH7 |
| | ADR | CWYCY | -- | -- | CWYCY.PK | B3F9NV4 |
| Dawning Information Industry Co (Sugon) | A-Share | 603019 | 603019.SS | BRKB8G3 | 603019.SH | BZ0D207 |
| Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd (Hikvision) | A-Share | 2415 | 002415.SZ | B450X03 | 002415.ZK | BD5CPQ2 |
| Semiconductor Manufacturing International Corp. | A-Share | 688981 | 688981.SS | BLN7Y13 | -- | -- |
| | H-Share | 981 | -- | -- | 0981.HK | BDFBM13 |
| | ADR | SMICY | -- | -- | SMICY.PK | 2429409 |

¹ La tabla enlista solamente las compañías y valores identificados en la Orden Ejecutiva dentro del universo de renta variable de S&P DJI.

Cualquier valor en la tabla anterior que sea un componente activo de algún índice de renta variable de S&P DJI se eliminará de todos los indicadores de los que forme parte, siendo efectivo antes de la apertura del Lunes 21 de Diciembre de 2020. La eliminación de componentes será incluida en primera instancia en los archivos proforma (* PRO.SDC) y de eventos corporativos (* SDE) publicados el Viernes 11 de Diciembre de 2020.

La tabla anterior enlista únicamente títulos de renta variable emitidos por las entidades nombradas explícitamente en la Orden Ejecutiva, más no ninguna empresa afiliada. S&P DJI continuará monitoreando cualquier actualización de la lista de entidades nombradas, así como las aclaraciones sobre el alcance de la Orden Ejecutiva en lo que respecta a las afiliadas y cualquier otro asunto relevante. Cualquier actualización adicional publicada antes del cierre del mercado de los EE. UU. el Viernes 11 de Diciembre de 2020 será evaluada por S&P DJI y, si corresponde, implementada junto con la fecha efectiva del rebalanceo del 21 de Diciembre de 2020. Las actualizaciones posteriores al cierre del mercado de los EE. UU. del Viernes 11 de Diciembre de 2020 serán evaluadas por S&P DJI y, si corresponde, implementadas en una fecha a determinar. S&P DJI también emitirá una notificación detallando el tratamiento que resulte de cualquier actualización adicional.

A continuación, se muestra una lista de los índices de renta variable afectados. Tenga en cuenta que, aunque no se enumeran a continuación, los subíndices relevantes (por ejemplo, índices de sector, tamaño e índices regionales) y los índices de esquemas de ponderación alternativos (es decir, con topes) también se ven afectados.

| Índice | Código |
|---|---------------|
| S&P Global BMI (USD) | SPCBMIRGLUSD |
| S&P China BMI (USD) | SPCBMICCNUSD |
| S&P Emerging BMI (USD) | SPCBMIREMUSD |
| S&P Emerging BMI (China A Full Inclusion) (USD) | SPECA1UP |
| S&P GIVI Global Index (US Dollar) | SPIVIRGLUSD |
| S&P GIVI Emerging Index (US Dollar) | SPIVIREMUSD |
| S&P GIVI Global Growth Markets Tilt Index (US Dollar) | SPIVIITRGLUSD |
| S&P Emerging Market Dividend Opportunities Index | SPGTEDUP |
| S&P Global Ex-Japan LargeMidCap Carbon Efficient Index (USD) | SPGJCEUP |
| Dow Jones Global Index | W1DOW |
| Dow Jones China Broad Market Index | DJCHINA |
| Dow Jones China Index (USD) | D065111 |
| Dow Jones China 88 Index | DJCHN88 |
| Dow Jones China Offshore 50 Index | DJCHOS50 |
| Dow Jones Emerging Markets Index | W5DOW |
| Dow Jones Islamic Market World Index | DJIM |
| Dow Jones Islamic Market China Index (USD) | DI26238 |
| Dow Jones Islamic Market China A 100 Index (USD) | DJICH1UP |
| Dow Jones Islamic Market World Emerging Markets Index | DJIEMG |
| Dow Jones Sustainability World Diversified Index | DJSWDIUP |
| Dow Jones Sustainability Emerging Markets Diversified Index | DJSEMDUP |
| S&P Access China A 50 Index (USD) | SPAC50UP |
| S&P Access China A Index (USD) | SPACAIUP |
| S&P Access China Enterprises Enhanced Value Index (CNY) | SPACEVCP |
| S&P Access Hong Kong Index (USD) | SPAHIUP |
| S&P Access Hong Kong Low Volatility High Dividend Index (HKD) | SPAHLVHP |
| S&P China 500 (USD) | SPC500UP |
| S&P China A Carbon Efficient Index (USD) | SPCACEUP |
| S&P Emerging LargeMidCap Carbon Efficient Index (USD) | SPEXCEUP |
| S&P Emerging LargeMidCap ESG Index (USD) | SPELMUP |
| S&P Enhanced Value Global LargeMidCap Index (USD) | SEVGXUP |
| S&P China A 1800 Index (CNY) | SPCACCNP |
| S&P China A-Share Enhanced Value Index (CNY) | SPCAEVCP |
| S&P China A-Share Low Volatility Index (CNY) | SPCALVCP |
| S&P China A-Share Quality Index (CNY) | SPCAQCP |

ANUNCIO DEL ÍNDICE

| Índice | Código |
|--|----------------|
| S&P Emerging BMI High Income Index (USD) | SPCBMIHIREMUSD |
| S&P Global BMI High Income Index (USD) | SPCBMIHIRGLUSD |
| S&P Global LargeMidCap Carbon Efficient Index (USD) | SPGXCEUP |
| S&P BMI Emerging Markets High Beta Index | SPEMHBI |
| S&P BMI Emerging Markets Low Volatility Index | SPEMLVUP |
| S&P Enhanced Value Emerging LargeMidCap Index (USD) | SEVEMXUP |
| S&P Enhanced Value Pan Asia Ex-Japan LargeMidCap Index (USD) | SEVPJXUP |
| S&P Enhanced Value Pan Asia LargeMidCap Index (USD) | SEVPAXUP |
| S&P Momentum Emerging LargeMidCap Index (US Dollar) | SPEMMUP |
| S&P Momentum Emerging Plus LargeMidCap Index (US Dollar) | SPEMPMUP |
| S&P Momentum Global LargeMidCap Index (US Dollar) | SPGLMUP |
| S&P Momentum Pan Asia ex Japan LargeMidCap Index (US Dollar) | SPPAJMUP |
| S&P Momentum Pan Asia LargeMidCap Index (US Dollar) | SPPAMUP |
| S&P GIVI GDP Weighted Index (US Dollar) | SPIVIIGRGLUSD |
| S&P Intrinsic Value Weighted Global Index (US Dollar) | SPIVWRGLUSD |
| S&P Low Beta Global Index (US Dollar) | SPLBRGLUSD |

Para más información, consulte la metodología correspondiente en www.spdji.com.

Índices de Renta Fija

A partir del Lunes 21 de Diciembre de 2020² y de conformidad con la sección de Sanciones de la Metodología de las Políticas y Prácticas de los Índices de Renta Fija de S&P Dow Jones Indices, los valores de la tabla a continuación serán considerados como no elegibles para formar parte de los índices de renta fija de S&P DJI.

| Ticker | ISIN | Nombre del Emisor |
|------------------|--------------|---|
| CN101900007=RRPS | CND10001WSL0 | Aviation Industry Corporation of China Ltd |
| CN101900929=RRPS | CND10002DPC3 | Aviation Industry Corporation of China Ltd |
| CN101901392=RRPS | CND10002HNP1 | Aviation Industry Corporation of China Ltd |
| CN101754036=RRPS | CND1000142N4 | China Aerospace Science and Industry Corp Ltd |
| CN068016=RRPS | CND000000LJ6 | China Aerospace Science and Technology Corp |
| CN1380131=RRPS | CND100006HP7 | China Aerospace Science and Technology Corp |
| CN1380132=RRPS | CND1000090Q8 | China Aerospace Science and Technology Corp |
| CN122175SH=RRPS | CND10000GBD8 | China Communications Construction Co Ltd |
| CN101900857=RRPS | CND10002H1Z2 | China Communications Construction Co Ltd |
| CN155606SH=RRPS | CND10002GB71 | China Communications Construction Co Ltd |
| CN101900971=RRPS | CND10002DZZ3 | China Communications Construction Co Ltd |
| CN155853SH=RRPS | -- | China Communications Construction Co Ltd |
| CN163976SH=RRPS | -- | China Communications Construction Co Ltd |
| CN175001SH=RRPS | CND10003R421 | China Communications Construction Co Ltd |
| CN136420SH=RRPS | CND10000G024 | China Electronics Corp |
| CN136813SH=RRPS | CND10000KG49 | China Electronics Corp |
| CN155974SH=RRPS | CND10001YH25 | China Electronics Corp |
| CN1980249=RRPS | CND10002F8S4 | China Electronics Corp |
| CN163133SH=RRPS | CND1000318J8 | China Electronics Corp |
| CN175440SH=RRPS | -- | China Electronics Corp |
| CN112833SZ=RRPS | -- | China Electronics Technology Group Corp |
| CN112802SZ=RRPS | -- | China Electronics Technology Group Corp |
| CN042000186=RRPS | CND100034JP5 | China Electronics Technology Group Corp |
| CN101653021=RRPS | CND100018MF3 | China General Nuclear Power Corp |
| CN136869SH=RRPS | -- | China General Nuclear Power Corp |
| CN101800505=RRPS | CND10001KZQ9 | China General Nuclear Power Corp |
| CN101800492=RRPS | CND10001KYY6 | China General Nuclear Power Corp |
| CN155012SH=RRPS | -- | China General Nuclear Power Corp |
| CN101900365=RRPS | CND1000248C2 | China General Nuclear Power Corp |
| CN149001SZ=RRPS | -- | China General Nuclear Power Corp |
| CN101801147=RRPS | CND10001QCH4 | China National Chemical Corp Ltd |

² La tabla enlista solamente las compañías y valores identificados en la Orden Ejecutiva dentro del universo de renta fija de S&P DJI.

| Ticker | ISIN | Nombre del Emisor |
|------------------|--------------|--|
| CN101800016=RRPS | CND100015NH3 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN101800371=RRPS | CND1000165G9 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN101900397=RRPS | CND100025DZ5 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN101801336=RRPS | CND10001T8Q3 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN101900843=RRPS | CND10002GXQ0 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN101901168=RRPS | CND10002FVY0 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN101901584=RRPS | CND10002JD01 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN101901366=RRPS | CND10002HQT6 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN102000820=RRPS | CND100035GS2 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN102000602=RRPS | -- | China National Chemical Corp Ltd |
| CN101901302=RRPS | CND10002T767 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN102002155=RRPS | CND10003XKJ5 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN012002513=RRPS | CND10003H158 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN012002856=RRPS | CND10003KTT2 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN102000187=RRPS | CND10002R8R2 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN102000295=RRPS | CND10002S5N6 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN102000236=RRPS | -- | China National Chemical Corp Ltd |
| CN102000412=RRPS | -- | China National Chemical Corp Ltd |
| CN012001416=RRPS | CND100034L98 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN102001094=RRPS | CND100038264 | China National Chemical Corp Ltd |
| CN155979SH=RRPS | CND10001YH58 | China National Chemical Engineering Group Corp Ltd |
| CN1280163=RRPS | CND100005B20 | China National Nuclear Corp |
| CN101656022=RRPS | CND100018MM9 | China National Nuclear Corp |
| CN143003SH=RRPS | -- | China National Nuclear Corp |
| CN101800558=RRPS | CND100016SN8 | China National Nuclear Corp |
| CN101900160=RRPS | CND10001ZPR6 | China National Nuclear Corp |
| CN101900416=RRPS | CND100025BB0 | China National Nuclear Corp |
| CN155441SH=RRPS | CND10002JGT3 | China National Nuclear Corp |
| CN101900903=RRPS | CND10002DLF5 | China National Nuclear Corp |
| CN101900642=RRPS | CND100027TJ1 | China National Nuclear Corp |
| CN163987SH=RRPS | -- | China National Nuclear Corp |
| CN163986SH=RRPS | -- | China National Nuclear Corp |
| CN163937SH=RRPS | -- | China National Nuclear Corp |
| CN163938SH=RRPS | -- | China National Nuclear Corp |
| CN163648SH=RRPS | -- | China National Nuclear Corp |
| CN155970SH=RRPS | CND10001YJ72 | China Nuclear Engineering & Construction Corp Ltd |
| CN155919SH=RRPS | CND10002D4H8 | China Nuclear Engineering & Construction Corp Ltd |
| CN143502SH=RRPS | CND100010MK0 | China Railway Construction Corp Ltd |
| CN143978SH=RRPS | CND1000115T7 | China Railway Construction Corp Ltd |
| CN143961SH=RRPS | CND100010XP6 | China Railway Construction Corp Ltd |
| CN155856SH=RRPS | -- | China Railway Construction Corp Ltd |
| CN155855SH=RRPS | -- | China Railway Construction Corp Ltd |
| CN163969SH=RRPS | -- | China Railway Construction Corp Ltd |
| CN155868SH=RRPS | -- | China Railway Construction Corp Ltd |
| CN175209SH=RRPS | -- | China Railway Construction Corp Ltd |
| CN101900754=RRPS | CND10002FQT0 | China Shipbuilding Industry Corp Ltd |
| CN136756SH=RRPS | CND10000KTG5 | China South Industries Group Co Ltd |
| CN143129SH=RRPS | CND10000K0B2 | China South Industries Group Co Ltd |
| CN143170SH=RRPS | CND10000K5W7 | China South Industries Group Co Ltd |
| CN143769SH=RRPS | CND10001TRP9 | China South Industries Group Co Ltd |
| CN143975SH=RRPS | CND10001TRQ7 | China South Industries Group Co Ltd |
| CN155575SH=RRPS | -- | China South Industries Group Co Ltd |
| CN163494SH=RRPS | -- | China South Industries Group Co Ltd |
| CN1282205=RRPS | CND100005C60 | China State Shipbuilding Corp Ltd |
| CN1282345=RRPS | CND100005MX3 | China State Shipbuilding Corp Ltd |
| CN163500SH=RRPS | -- | China State Shipbuilding Corp Ltd |
| CN163276SH=RRPS | -- | China State Shipbuilding Corp Ltd |
| CN068022=RRPS | CND000000M81 | China Three Gorges Corp |
| CN1382092=RRPS | CND100006G16 | China Three Gorges Corp |
| CN101452024=RRPS | CND100018D15 | China Three Gorges Corp |

| Ticker | ISIN | Nombre del Emisor |
|------------------|--------------|--|
| CN101652023=RRPS | CND100018NL9 | China Three Gorges Corp |
| CN101652022=RRPS | CND100018NM7 | China Three Gorges Corp |
| CN101552031=RRPS | CND100018GF5 | China Three Gorges Corp |
| CN101552006=RRPS | CND100018DB1 | China Three Gorges Corp |
| CN101652015=RRPS | CND100018MZ1 | China Three Gorges Corp |
| CN136683SH=RRPS | CND10000CPG0 | China Three Gorges Corp |
| CN143876SH=RRPS | CND10001YFF5 | China Three Gorges Corp |
| CN143745SH=RRPS | -- | China Three Gorges Corp |
| CN143744SH=RRPS | CND10001PSZ4 | China Three Gorges Corp |
| CN131800018=RRPS | CND10001TP30 | China Three Gorges Corp |
| CN155180SH=RRPS | -- | China Three Gorges Corp |
| CN131900016=RRPS | CND10002FSX8 | China Three Gorges Corp |
| CN131900012=RRPS | CND10002DM06 | China Three Gorges Corp |
| CN155681SH=RRPS | -- | China Three Gorges Corp |
| CN131900024=RRPS | CND10002J8B6 | China Three Gorges Corp |
| CN163479SH=RRPS | -- | China Three Gorges Corp |
| CN163478SH=RRPS | -- | China Three Gorges Corp |
| CN012003723=RRPS | CND10003VLJ7 | China Three Gorges Corp |
| CN132000005=RRPS | -- | China Three Gorges Corp |
| CN122252SH=RRPS | -- | CRRC Corp Ltd |
| CN163335SH=RRPS | -- | CRRC Corp Ltd |
| CN101900258=RRPS | CND100022N41 | Semiconductor Manufacturing International Corp |
| KY210182845=RRPS | XS2101828452 | Semiconductor Manufacturing International Corp |

Cualquier valor en la tabla anterior que sea un componente activo de algún índice de renta fija de S&PDJI se eliminará de todos los indicadores de los que forme parte, siendo efectivo antes de la apertura del Viernes 1 de Enero de 2021 o el día siguiente de operación en bolsa del índice. La eliminación de componentes será incluida en primera instancia en los archivos proforma (*PRO.SPFIC) publicados el Lunes 28 de Diciembre de 2020.

La tabla anterior enlista únicamente títulos de renta variable emitidos por las entidades nombradas explícitamente en la Orden Ejecutiva, más no ninguna empresa afiliada. S&P DJI continuará monitoreando cualquier actualización de la lista de entidades nombradas, así como aclaraciones adicionales sobre el alcance de la Orden Ejecutiva en lo que respecta a las afiliadas y cualquier otro asunto relevante. Cualquier actualización adicional publicada antes del cierre del mercado de los EE. UU. el Lunes 28 de Diciembre de 2020 será evaluada por S&P DJI y, si corresponde, implementada junto con la fecha efectiva del rebalanceo del 1 de Enero de 2021. Las actualizaciones posteriores al cierre del mercado de EE. UU. del Lunes 28 de Diciembre de 2020 serán evaluadas por S&P DJI y, si corresponde, implementadas en una fecha por determinar. S&P DJI también emitirá una notificación detallando el tratamiento que resulte de cualquier actualización adicional.

A continuación, se muestra una lista de los índices de renta fija afectados. Tenga en cuenta que, aunque no se enumeran a continuación, los subíndices relevantes (por ejemplo, vencimiento, sector, tamaño e índices regionales) y los índices de esquemas de ponderación alternativos (es decir, con topes) también se ven afectados.

| Índice | Código |
|---|----------|
| S&P China Composite Select Bond Index | SPBCNSI |
| S&P China High Quality Corporate Bond 3-7 Year Index | SPBCNH3T |
| S&P China Corporate Bond Index | SPBCNCPT |
| S&P China Composite Bond Index | SPCCBI |
| S&P China Bond Index | SPBCNCOT |
| S&P Green Bond Index | SPUSGRN |
| S&P U.S. Foreign Issued Investment Grade Corporate Bond Index | SPUIGFO |
| S&P U.S. Dollar Global Investment Grade Corporate Bond Index | SPUSGIG |
| S&P Global Developed Corporate Bond Index (USD) | SPDCORP |
| S&P U.S. Government/Credit Bond Index | SPUSCGV |

ANUNCIO DEL ÍNDICE

| Índice | Código |
|---|---------|
| S&P Global Developed Aggregate Ex-Collateralized Bond Index (USD) | SPDABXC |
| S&P U.S. Aggregate Bond Index | SPUSAGG |

Para más información, consulte la metodología correspondiente en www.spdji.com.

Para mayor información, visite nuestro sitio web www.spdji.com.

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