

Actualización de la metodología de los S&P ESG Tilted Indices

ÁMSTERDAM, 5 DE MARZO DE 2026: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) anuncia cambios en la metodología de los S&P ESG Tilted Indices.

Para alinearse mejor con el cálculo de la Puntuación ESG de S&P Global ESG de los índices subyacentes, S&P DJI alinea el cálculo de la Puntuación ESG Sesgada (Tilt) como se describe a continuación.

Metodología		
Cambio	Anterior	Actualización
Ponderación de los componentes	Cada puntuación sesgada por ESG (S_i) se calcula de la siguiente manera: - El puntaje ESG de S&P Global para cada compañía se transforma en un puntaje ESG-z (Z_i) en el nivel de índice subyacente según se describe a continuación: Dividiendo por 100 y tomando la inversa de la función de distribución acumulativa normal con una media de cero y una desviación estándar de uno. - El puntaje ESG-z (Z_i) para cada valor se vuelve a estandarizar utilizando la desviación estándar y la media de los valores z ESG de S&P Global disponibles para las compañías dentro del universo del índice, antes de aplicar exclusiones basadas en actividades comerciales y por puntuaciones no calificables según UNGC.	La Puntuación ESG Tilt (S_i) se calcula de la siguiente manera: - La Puntuación Global ESG S&P de cada empresa se transforma en una puntuación z ESG (Z_i) a nivel del índice subyacente según se describe a continuación: - La Puntuación ESG de S&P Global se vuelve a estandarizar utilizando la desviación estándar y la media de los valores z ESG de S&P Global disponibles para las compañías dentro del universo del índice, antes de aplicar exclusiones basadas en actividades comerciales y por puntuaciones no calificables según UNGC.

ÍNDICES IMPACTADOS

Índice	Código	Metodología
S&P 500 ESG Tilted (Heavy) Index (USD)	SPXETHUP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P 500 ESG Tilted (Light) Index (USD)	SPXETLUP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P 500 ESG Tilted (Moderate) Index (USD)	SPXETMUP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P 500 ESG Tilted Index (USD)	SPXETUP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P Composite 1500 ESG Tilted Index (USD)	SPCESTUP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P Developed Ex-North America & Korea LargeMidCap ESG Tilted Index (USD)	SPDESTUP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P/NZX 50 Portfolio ESG Tilted Index (NZD)	SPN5ETNP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P/NZX 50 ESG Tilted 15/40 Capped Index (NZD)	SP5NETNP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P China A 300 ESG Tilted (Heavy) Index (CNY)	SPC3EHCP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P China A 300 ESG Tilted Index (NS Series) (CNY)	SPC3ENCNP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P China A 300 ESG Tilted Index (CNY)	SPC3ETCP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P China A 300 ESG Tilted (Heavy) Index (NS Series) (CNY)	SPC3NHCP	S&P ESG Tilted Index Series Methodology
S&P/BMV IPC CompMx Trailing Income Equities ESG Tilted Index (MXN)	GM0000	S&P/BMV Indices Methodology

Índice	Código	Metodología
S&P/BMV IPC ESG Tilted (Heavy) Index (MXN)	MY0000	S&P/BMV Indices Methodology
S&P/BMV IPC ESG Tilted (Light) Index (MXN)	MP0000	S&P/BMV Indices Methodology
S&P/BMV IPC ESG Tilted (Moderate) Index (MXN)	MW0000	S&P/BMV Indices Methodology
S&P/BMV IPC ESG Tilted Index (MXN)	ML0000	S&P/BMV Indices Methodology
S&P IPSA ESG Tilted Index (CLP)	SPCLETCP	S&P/CLX Indices Methodology
S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Index (1.0) (JPY)	SPJPEAJP	S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Indices Methodology
S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Index (2.0) (JPY)	SPJPEHJP	S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Indices Methodology
S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Index (0.25) (JPY)	SPJPELJP	S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Indices Methodology
S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Index (0.5) (JPY)	SPJPEMJP	S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Indices Methodology
S&P/TSX 60 ESG Index (CAD)	SPTSETCP	S&P/TSX ESG Indices Methodology
S&P/TSX Composite ESG Tilted Index (CAD)	TXSGT	S&P/TSX ESG Indices Methodology

CALENDARIO DE IMPLEMENTACIÓN

S&P ESG Tilted y S&P/TSX ESG Indices. S&P DJI implementará los citados cambios con el rebalanceo de abril de 2026, siendo efectivo antes de la apertura del mercado del **viernes 1 de mayo de 2026**. Los cambios serán visibles para nuestros clientes en los archivos pro-forma a partir del **jueves 23 de abril de 2026**.

S&P/JPX 500 ESG Score Tilted Indices. S&P DJI implementará los citados cambios con el rebalanceo de mayo de 2026, siendo efectivo antes de la apertura del mercado del **lunes 1 de junio de 2026**. Los cambios serán visibles para nuestros clientes en los archivos pro-forma a partir del **viernes 22 de mayo de 2026**.

S&P/BMV y S&P/CLX Indices. S&P DJI implementará los citados cambios con el rebalanceo de junio de 2026, siendo efectivo antes de la apertura del mercado del **lunes 22 de junio de 2026**. Los cambios serán visibles para nuestros clientes en los archivos pro-forma a partir del **viernes 12 de junio de 2026**.

ACERCA DE LOS ÍNDICES S&P DOW JONES

Los índices Dow Jones del S&P son el mayor recurso global para conceptos esenciales basados en índices, datos e investigaciones, y albergan indicadores icónicos del mercado financiero, como el S&P 500® y el Dow Jones Industrial Average®. Se invierten más activos en productos basados en nuestros índices que en productos basados en índices de cualquier otro proveedor en el mundo. Desde que Charles Dow inventó el primer índice en 1884, S&P DJI ha estado innovando y desarrollando índices a lo largo del espectro de clases de activos, ayudando a definir la forma en que los inversores miden y negocian los mercados.

ANUNCIO DEL ÍNDICE

S&P Dow Jones Indices es una división de S&P Global (NYSE: SPGI), que proporciona inteligencia esencial para que individuos, empresas y gobiernos tomen decisiones con confianza. Para más información, visita www.spglobal.com/spdji.

PARA MÁS INFORMACIÓN:

S&P Dow Jones Indices

index_services@spglobal.com