



Índices FTSE BIVA



+

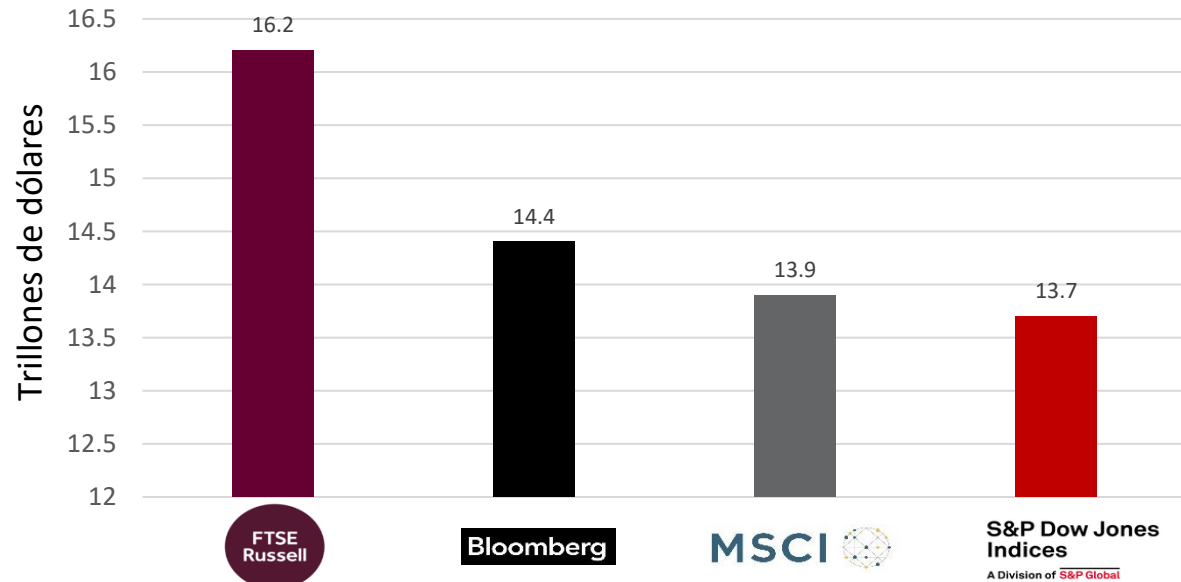
Bolsa Institucional
de Valores

B I V A ^ =

FTSE BIVA

FTSE Russell

- Forma parte de London Stock Exchange Group (LSEG), es pionero en la creación, cálculo y distribución de índices.
- Más de **30 años** de experiencia y **16.2 trillones** de dólares asociados a sus índices.



*Datos a dic de 2018

- Calculan más de 400,000 índices diariamente en más de **70 países**, cubriendo el **98%** del mercado en el que se puede invertir a nivel mundial.
- FTSE Russell se enfoca en la creación y mantenimiento de índices y los servicios de información asociados a esto.

Índice FTSE BIVA

Dentro de la familia de índices, hemos diseñado un índice insignia moderno y representativo del mercado mexicano, que será distribuido mundialmente. Algunas de las principales

- Peso por valor de capitalización.
- Todas las empresas listadas en el país son consideradas, incluyendo FIBRAs.
- Cálculo de liquidez mínima usando reglas de FTSE apegadas a estándares internacionales.
- Rebalanceos semestrales. Se pueden incluir IPOs relevantes antes del rebalanceo.
- Gobierno corporativo de FTSE Russell para manejo de conflictos.

Una asociación
con FTSE Russell

Índice FTSE BIVA

- Representa al mercado de valores mexicano.
- No tiene un número fijo de participantes; a medida que crece el mercado, el número de integrantes crecerá.
- Incluye FIBRAs como sector representativo de la economía.
- Se basa en reglas con los más altos estándares, establecidas por FTSE Russell.
- Es replicable fácilmente al tener criterios mínimos de liquidez.
- Empezó 2018 con un valor de 1,000 puntos por lo que es fácil medir el comportamiento del mercado.
- Ninguna empresa puede pesar más de 15% del índice.
- Es distribuido mundialmente.

Beneficios de ser parte del FTSE BIVA

- Mayor visibilidad para la empresa a nivel global.
 - Atracción de flujos internacionales.
 - Acceso a inversionistas institucionales.
- Aumento en la operación por activos ligados al índice (ETFs, fondos, derivados).
- Mejora en la valuación.
- Prestigio al representar una industria o sector.
- Aumenta la cobertura de analistas.



Criterios de inclusión para el FTSE BIVA

✓ Tamaño de la empresa

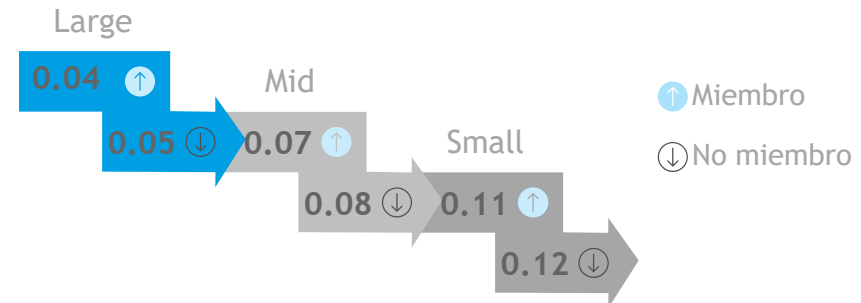
El tamaño mínimo de capitalización de mercado para ser incluido varía cada rebalanceo.



✓ Liquidez mínima

La mediana mensual del ADTV (volumen promedio operado diario) dividida entre el “float” ajustado, debe de pasar los criterios mínimos establecidos según el tamaño de la empresa en por lo menos 8 de 12 meses.

$\frac{\text{Mediana de Acciones operadas por día}}{\text{\# Acciones flotantes}}$ =Factor de Liquidez Diario (bps)



✓ Historial de operación

La empresa debe haber estado listada por lo menos 3 meses antes de la fecha de medición para el rebalanceo.



Composición del Índice FTSE BIVA Y FTSE4G

LARGE		
	FTSE	FTSE4G
Gfnorte O	12.18%	16.35%
Amx B	8.93%	12.00%
Femsa UBD	9.75%	13.10%
Walmex *	7.92%	10.64%
Gmexico B	9.72%	13.05%
Bimbo A	3.36%	4.51%
Cemex CPO	5.25%	7.05%
Gfinbur O	3.20%	
AC *	3.22%	4.32%
Gcarso A1	1.80%	
Chdraui B	0.82%	
Pinfra *	1.26%	
Kimber A	0.76%	1.03%
Tlevic CPO	0.41%	0.76%
Livopol C-1	0.54%	
EMISORAS	15	9 

MID		
	FTSE	FTSE4G
GAP	4.28%	5.74%
Asur B	3.03%	
Funo 11	1.91%	2.57%
Kof UBL	2.66%	3.57%
Oma B	1.56%	
Gruma	1.83%	
Alfa A	1.81%	
BBajio O	1.02%	
Orbia *	0.42%	0.57%
Alsea *	0.62%	
Regional (RA)	0.94%	
Peñoles *	1.86%	
Cuervo *	0.27%	0.37%
Sites A1	0.37%	
Nemak A	0.16%	
Mega CPO	0.36%	
Traxión A	0.18%	
Terra13	0.08%	
Alpek A	0.12%	0.17
EMISORAS	19	6 

SMALL		
	FTSE	FTSE4G
GCC *	0.91%	1.22%
Q *	0.98%	1.32%
Gentera *	0.86%	
Vesta *	1.15%	
Volar A	0.30%	
Bolsa A	0.48%	
Lab B	0.51%	
Lacomer UBC	0.23%	
Fibrapl	1.81%	2.44%
Danhos 13	0.15%	
EMISORAS	10	3 
TOTAL EMISORAS FTSE	44	
TOTAL EMISORAS FTSE4G	18	

Nota: muestra marzo del 2025.



BIVA

biva.mx

Lanzamiento del ETF sobre el índice FTSE BIVA

El 26 de septiembre de 2019, Vanguard junto con FTSE Russell y BIVA lanzaron un ETF que replica el rendimiento del índice FTSE BIVA.

Vanguard cuenta con:

- Más de 40 años de experiencia
- Manejan \$5.1 trillones de dólares en activos
- Más de 20 millones de clientes en más de 170 países

El ETF es el primer instrumento local en México para Vanguard.

- El ticker es **VMEX**.

Bolsa Institucional
de Valores

BIVA

**FTSE
Russell**



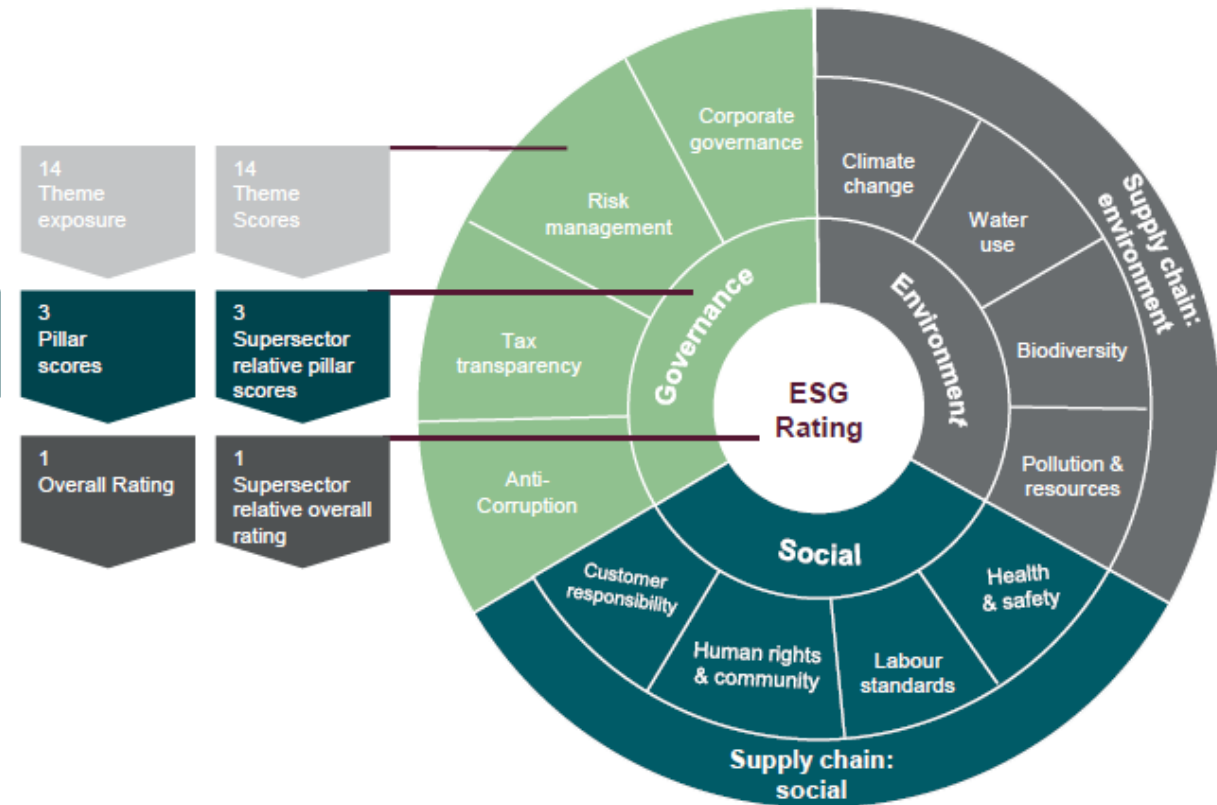
Vanguard®

Índice FTSE4Good BIVA

El FTSE4Good BIVA fue diseñado para medir el desempeño de las empresas en México que demuestran sólidas prácticas ESG.

Algunas de sus características:

- Las empresas son calificadas en una escala ESG y deben cumplir **mínimos estándares** para ser consideradas.
- Basado en 3 pilares con 14 temas y 300+ indicadores de sustentabilidad de las empresas.
- Metodología transparente
- Supervisado por el comité ESG de FTSE Russell, compuesto por profesionales y expertos líderes en el mercado de inversión responsable global.
- 20 años de experiencia en índices sustentables con la serie FTSE4Good



Una muestra más del compromiso tenemos en BIVA con el mercado de valores para fomentar la inversión sustentable y alentar a las empresas a cumplir cada día con mejores prácticas.

Bolsa Institucional
de Valores **B I V A**

Una empresa de:



CENCOR

25 años desarrollando infraestructura
para mercados financieros



biva.mx