serfieX
risk management & ALM

Índices MPI MarketPortfolioIndex™" de renta variable: statements

V.4 28 de abril de 2025

serfieX
risk management & ALM
© 2025 SERFIEX, S.A. All Rights Reserved

Índice MPI Equity

Articulo 1 (Comunicación general)	
Nombre de índice de referencia	Indice MPI Equity
Grupo de índice de referencia	Índices MPI
Tipo de índice de referencia	Índice de referencia no significativo
Disponibilidad de índice de referencia	www.serfiex.es
Fecha de publicación del informe inicial de índice de referencia	10 de mayo de 2023
Fecha de última actualización de informe índice de referencia	28 de abril de 2025
Contribuidor de datos	Plataforma SIX. Fuente alternativa: Reuters Eikon

2 Con el fin de definir las principales claves referentes al índice o grupo de índices de referencia, y, en particular, al mercado o realidad económica medida por el índice o los grupos de índices de referencia, el informe de índice de referencia debería contener la información siguiente:	
(a) una descripción general del mercado o realidad económica;	El índice MPI Equity mide la rentabilidad total de una cartera de 100 acciones emitidas por las empresas de los 16 países con mayor PIB del mundo Véase la Metodología de Índices MPI de renta variable de Serfiex
(b) las fronteras geográficas del mercado o realidad económica, cuando proceda;	Acciones emitidas por las empresas de los 16 países con mayor PIB del mundo
(c) otra información relevante que considere el administrador beneficioso para un usuario del índice de referencia, para que entienda las características relevantes del mercado o realidad económica. Sujeto a la disponibilidad de datos fiables, el administrador considerará incluir, entre otros: (1) información sobre participantes corrientes o potenciales en el mercado (2) barreras al mercado (3) una indicación del tamaño del mercado o realidad económica.	No es pertinente al índice (no es significativo)

3. Con el fin de definir los potenciales límites del índice o grupos de índices de referencia, y, en particular, las situaciones en las que la medida del mercado o realidad económica relevante podría ser incorrecta, el informe del índice de referencia deberá contemplar, teniendo en consideración la metodología utilizada para el índice o grupo de índices de referencia, al menos los siguientes elementos:	
(a) las situaciones en que el administrador no tenga datos suficientes para determinar el índice de referencia según la metodología;	Véase la Metodología de Índices Mpi de renta variable de Serfiex

(b) las situaciones en que el nivel de liquidez del mercado es insuficiente para asegurar la integridad y fiabilidad del índice de referencia según la metodología;	No es pertinente al índice (no es significativo)
(c) otra información relevante que considere el administrador beneficioso para un usuario del índice de referencia, para entender las situaciones en las que la medida del mercado o realidad económica relevante podría ser incorrecta,	No es pertinente al índice (no es significativo)

4. Con el fin de proporcionar información sobre los controles y reglas que rigen cualquier ejercicio de juicio o discreción en el cálculo del índice o grupo de índices de referencia, el informe del índice de referencia deberá:	
(a) indicar la posición de cada función o conjunto que pueda suponer discreción;	No es pertinente al índice (no es significativo)
(b) describir cada paso de cualquier proceso de evaluación ex-post sobre la discreción, incluyendo una referencia clara a cualquier persona que evalúe la discreción.	No es pertinente al índice (no es significativo)

5. Con el fin de proporcionar información sobre la revisión de la metodología y comunicar a los usuarios los cambios o la suspensión del índice o grupo de índices de referencia, el informe del índice de referencia deberá:	
(a) referirse a los procedimientos de consulta pública sobre cada cambio en la metodología;	Véase la Metodología de Índices Mpi de renta variable de Serfiex
(b) en la medida conocida, indicar posibles impactos en el índice o grupo de índices de referencia por cambios en contratos financieros, instrumentos financieros que se refieren al índice de referencia o la actuación de fondos de inversión.	No es pertinente al índice (no es significativo)

6. El administrador de índices de referencia puede incluir información adicional al final del informe del índice de referencia, vinculado a un documento accesible y gratuito.	
(a) Información adicional.	Véase la Metodología de Índices MPI de renta variable de Serfiex

Artículo 6 (Requisitos específicos de divulgación para índices de referencia significativos y no significativos) Además del Artículo 1, para un índice o grupo de índices de referencia con datos regulados, el informe del índice de referencia deberá:	
1. Además del Artículo 1, para índices de referencia significativos o grupos de índices que solamente incluyen índices significativos, el informe del índice de referencia deberá indicar la calificación del índice(s) de referencia como un índice de referencia significativo con arreglo al punto 26 del Artículo 3(1) de Regulación (UE) 2016/1011	No es pertinente al índice (no es significativo)

2. Además del Artículo 1, para índices de referencia no significativos o grupos de índices que solamente incluyen índices no significativos, el informe del índice de referencia deberá indicar la calificación del índice(s) de referencia como un índice de referencia no significativo con arreglo al punto 27 del Artículo 3(1) de Regulación (UE) 2016/1011	El índice MPI Equity es un índice de referencia no significativo según el Artículo 3(27), el cual define índice no significativo como aquel índice de referencia que no cumple las condiciones de los Artículos 20(1) y 24(1). El índice MPI Equity no cumple el umbral requerido en las estimaciones en cuanto a volumen de contratos, instrumentos o fondos de inversión que los utilizan.
3. Además del Artículo 1, para grupos de índices que incluyen índices significativos y no significativos, el informe del índice de referencia deberá indicar la inclusión de ambos tipos de índices en el grupo: índices significativos según el punto 26 del Artículo 3(1) del Reglamento (UE) 2016/1011 e índices no significativos según el punto 27 del Artículo 3(1) del Reglamento (UE) 2016/1011	No es pertinente al índice (no es significativo)
Artículo 7 (Actualizaciones). Se requiere una actualización del informe del índice de referencia cuando la información que refleja no es correcta o suficientemente exacta y, al menos, cuando:	
(a) hay un cambio en el tipo de índice de referencia	Se actualizará el informe del índice de referencia
(b) hay un cambio sustancial en la metodología del índice de referencia o, cuando se hace referencia a un grupo de índices, hay modificaciones en la metodología de cualquiera de los índices incluidos	Véase la Metodología de Índices MPI de renta variable de Serfiex

SECCIÓN 1 – CONSIDERACIÓN DE LOS FACTORES ASG	
Elemento 1. Nombre del administrador del índice de referencia.	SERFIEX
Elemento 2. Tipo de índice de referencia o familia de índices de referencia.	Renta variable
Elemento 3. Nombre del índice de referencia o de la familia de índices de referencia.	MPI Equity
Elemento 4. ¿La cartera del administrador de los índices de referencia contiene índices de referencia de transición climática de la UE, índices de referencia de la UE armonizados con el Acuerdo de París, índices de referencia que persigan objetivos ASG o índices de referencia que tengan en cuenta factores ASG?	No
Elemento 5. ¿El índice de referencia o la familia de índices de referencia persigue objetivos ASG?	No

Índice MPI Equity&Bonds

Articulo 1 (Comunicación general)	
Nombre de índice de referencia	Indice MPI Equity & Bonds
Grupo de índice de referencia	Índices MPI
Tipo de índice de referencia	Índice de referencia no significativo
Disponibilidad de índice de referencia	www.serfiex.es
Fecha de publicación del informe inicial de índice de referencia	10 de mayo de 2023
Fecha de última actualización de informe índice de referencia	28 de abril de 2025
Contribuidor de datos	Plataforma SIX y los bonos de la plataforma SENAF de BME Renta Fija, Frankfurt S.E. y Stuttgart Exchange Fuente alternativa: Reuters Eikon

2 Con el fin de definir las principales claves referentes al índice o grupo de índices de referencia, y, en particular, al mercado o realidad económica medida por el índice o los grupos de índices de referencia, el informe de índice de referencia debería contener la información siguiente:	
(a) una descripción general del mercado o realidad económica;	El índice MPI Equity & Bonds mide la rentabilidad total de tres carteras: • Una cartera de 100 acciones emitidas por empresas de los 16 países con mayor PIB de Europa, América, Asia y Australia. Los componentes del índice MPI Equity • Una cartera de 12 bonos con vencimiento superior a 1 año emitidos por los Gobiernos de los 11 países con mayor PIB de Europa y América. Los componentes del índice World Demi Gov Bonds • Una cartera de 100 bonos con vencimiento superior a 1 año emitidos por empresas de los 11 países con mayor PIB de Europa y América. Los componentes del índice World Demi Corp Bonds En total 212 activos para replicar el mundo. ¡Menos es más! Véase la Metodología de Índices MPI de renta variable de Serfiex
(b) las fronteras geográficas del mercado o realidad económica, cuando proceda;	Acciones emitidas por las empresas de los 16 países con mayor PIB del mundo,

(c) otra información relevante que considere el administrador beneficioso para un usuario del índice de referencia, para que entienda las características relevantes del mercado o realidad económica. Sujeto a la disponibilidad de datos fiables, el administrador considerará incluir, entre otros: (1) información sobre participantes corrientes o potenciales en el mercado (2) barreras al mercado (3) una indicación del tamaño del mercado o realidad económica.	No es pertinente al índice (no es significativo)

3. Con el fin de definir los potenciales límites del índice o grupos de índices de referencia, y, en particular, las situaciones en las que la medida del mercado o realidad económica relevante podría ser incorrecta, el informe del índice de referencia deberá contemplar, teniendo en consideración la metodología utilizada para el índice o grupo de índices de referencia, al menos los siguientes elementos:	
(a) las situaciones en que el administrador no tenga datos suficientes para determinar el índice de referencia según la metodología;	Véase la Metodología de Índices MPI de renta variable de Serfiex
(b) las situaciones en que el nivel de liquidez del mercado es insuficiente para asegurar la integridad y fiabilidad del índice de referencia según la metodología;	No es pertinente al índice (no es significativo)
(c) otra información relevante que considere el administrador beneficioso para un usuario del índice de referencia, para entender las situaciones en las que la medida del mercado o realidad económica relevante podría ser incorrecta,	No es pertinente al índice (no es significativo)

4. Con el fin de proporcionar información sobre los controles y reglas que rigen cualquier ejercicio de juicio o discreción en el cálculo del índice o grupo de índices de referencia, el informe del índice de referencia deberá:	
(a) indicar la posición de cada función o conjunto que pueda suponer discreción;	No es pertinente al índice (no es significativo)
(b) describir cada paso de cualquier proceso de evaluación ex-post sobre la discreción, incluyendo una referencia clara a cualquier persona que evalúe la discreción.	No es pertinente al índice (no es significativo)

5. Con el fin de proporcionar información sobre la revisión de la metodología y comunicar a los usuarios los cambios o la suspensión del índice o grupo de índices de referencia, el informe del índice de referencia deberá:	
(a) referirse a los procedimientos de consulta pública sobre cada cambio en la metodología;	Véase la Metodología de Índices MPI de renta variable de Serfiex
(b) en la medida conocida, indicar posibles impactos en el índice o grupo de índices de referencia por cambios en contratos financieros, instrumentos financieros que se refieren al índice de referencia o la actuación de fondos de inversión.	No es pertinente al índice (no es significativo)

6. El administrador de índices de referencia puede incluir información adicional al final del informe del índice de referencia, vinculado a un documento accesible y gratuito.

(a) Información adicional.	Véase la Metodología de Índices MPI de renta variable de Serfiex

Artículo 6 (Requisitos específicos de divulgación para índices de referencia significativos y no significativos) Además del Artículo 1, para un índice o grupo de índices de referencia con datos regulados, el informe del índice de referencia deberá:	
1. Además del Artículo 1, para índices de referencia significativos o grupos de índices que solamente incluyen índices significativos, el informe del índice de referencia deberá indicar la calificación del índice(s) de referencia como un índice de referencia significativo con arreglo al punto 26 del Artículo 3(1) de Regulación (UE) 2016/1011	No es pertinente al índice (no es significativo)
2. Además del Artículo 1, para índices de referencia no significativos o grupos de índices que solamente incluyen índices no significativos, el informe del índice de referencia deberá indicar la calificación del índice(s) de referencia como un índice de referencia no significativo con arreglo al punto 27 del Artículo 3(1) de Regulación (UE) 2016/1011	El índice MPI Equity&Bonds es un índice de referencia no significativo según el Artículo 3(27), el cual define índice no significativo como aquel índice de referencia que no cumple las condiciones de los Artículos 20(1) y 24(1). El índice MPI Equity no cumple el umbral requerido en las estimaciones en cuanto a volumen de contratos, instrumentos o fondos de inversión que los utilizan.
3. Además del Artículo 1, para grupos de índices que incluyen índices significativos y no significativos, el informe del índice de referencia deberá indicar la inclusión de ambos tipos de índices en el grupo: índices significativos según el punto 26 del Artículo 3(1) del Reglamento (UE) 2016/1011 e índices no significativos según el punto 27 del Artículo 3(1) del Reglamento (UE) 2016/1011	No es pertinente al índice (no es significativo)
Artículo 7 (Actualizaciones). Se requiere una actualización del informe del índice de referencia cuando la información que refleja no es correcta o suficientemente exacta y, al menos, cuando:	
(a) hay un cambio en el tipo de índice de referencia	Se actualizará el informe del índice de referencia
(b) hay un cambio sustancial en la metodología del índice de referencia o, cuando se hace referencia a un grupo de índices, hay modificaciones en la metodología de cualquiera de los índices incluidos	Véase la Metodología de Índices MPI de renta variable de Serfiex

SECCIÓN 1 – CONSIDERACIÓN DE LOS FACTORES ASG	
Elemento 1. Nombre del administrador del índice de referencia.	SERFIEX
Elemento 2. Tipo de índice de referencia o familia de índices de referencia.	Otros
Elemento 3. Nombre del índice de referencia o de la familia de índices de referencia.	MPI Equity&Bonds
Elemento 4. ¿La cartera del administrador de los índices de referencia contiene índices de referencia de transición climática de la UE, índices de referencia de la UE armonizados con el Acuerdo de París, índices de referencia que persigan objetivos ASG o índices de referencia que tengan en cuenta factores ASG?	No
Elemento 5. ¿El índice de referencia o la familia de índices de referencia persigue objetivos ASG?	No

www.serfiex.com
andrea.comanescu@serfiex.es
+34 91 319 03 47

© 2020 SERFIEX, S.A. All Rights Reserved